

# 東京海上ターゲット・ イヤー・ファンド2055

<愛称 年金コンパス>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |   |       |                             |       |
|--------|--|---|-------|-----------------------------|-------|
| 商品分類   | 追加型投信／内外／資産複合<br>(課税上は株式投資信託として取扱われます。)  |   |       |                             |       |
| 信託期間   | 無期限 (2019年9月20日設定)   |   |       |                             |       |
| 運用方針   | 信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。  |   |       |                             |       |
| 主要投資対象 | 東京海上ターゲット・<br>イヤー・ファンド2055   | 以下4つのマザーファンドを主<br>要投資対象とします。  |       |                             |       |
|        | T M A 日本 株<br>T O P I X<br>マザーファンド   | 東京証券取引所第一部上場株式  |       |                             |       |
|        | T M A 日本 債券<br>インデックス<br>マザーファンド   | わが国の公社債   |       |                             |       |
|        | T M A 外国 株 式<br>インデックス<br>マザーファンド  | 外国の株式   |       |                             |       |
|        | T M A 外国 債券<br>インデックス<br>マザーファンド   | 外国の公社債  |       |                             |       |
|        | 東京海上ターゲット・<br>イヤー・ファンド2055   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</li> </ul> |       |                             |       |
| 投資制限   | T M A 日本 株<br>T O P I X<br>マザーファンド   | 株式<br>への<br>投資<br>制限  | 制限なし  | 外貨<br>建資產<br>への<br>投資<br>制限 | 20%以下 |
|        | T M A 日本 債券<br>インデックス<br>マザーファンド   |   | 10%以下 |                             | 20%以下 |
|        | T M A 外国 株 式<br>インデックス<br>マザーファンド  |   | 制限なし  |                             | 制限なし  |
|        | T M A 外国 債券<br>インデックス<br>マザーファンド   |   | 10%以下 |                             | 制限なし  |
|        | 毎決算時に、原則として経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。<br>収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益について、運用の基本方針に基づいて運用を行います。            |   |       |                             |       |
| 分配方針   | 東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング<br>お問い合わせ窓口<br>東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-0116<br>受付時間：営業日の9時～17時<br><a href="https://www.tokiomarineam.co.jp/">https://www.tokiomarineam.co.jp/</a> |   |       |                             |       |

## 第3期 運用報告書（全体版）

(決算日 2022年1月25日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお  
礼申し上げます。  
さて、「東京海上ターゲット・イヤー・  
ファンド2055<愛称 年金コンパス>」  
は、このたび、第3期の決算を行いま  
したので、期中の運用状況をご報告申  
し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜ります  
よう、お願い申し上げます。

### 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。  
また、一印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

## ○設定以来の運用実績

| 決 算 期               | 基 準 価 額<br>(分配落) | 基 準 価 額 |        |        | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 証 券 組 入 比 率 | 純 資 産 額  |
|---------------------|------------------|---------|--------|--------|-------------|-----------|-------------|-------------------|----------|
|                     |                  | 税 分     | 込 配    | み 期    | 中 腸         | 落 率       |             |                   |          |
| (設定日)<br>2019年9月20日 | 円<br>10,000      | 円<br>—  | %<br>— | %<br>— | %<br>—      | %<br>—    | %<br>—      | %<br>—            | 百万円<br>1 |
| 1期(2020年1月27日)      | 10,565           | 0       | 5.7    | 65.2   | 1.9         | 31.7      | 0.9         | 0.9               | 1        |
| 2期(2021年1月25日)      | 11,445           | 0       | 8.3    | 64.5   | 3.5         | 31.1      | 0.7         | 0.7               | 44       |
| 3期(2022年1月25日)      | 12,487           | 0       | 9.1    | 61.6   | 2.3         | 35.1      | 0.7         | 0.7               | 233      |

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額<br>騰 落 率 | 基 準 価 額 |           |          | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 証 券 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|---------------------|------------------|---------|-----------|----------|-------------|-----------|-------------|-------------------|---------|
|                     |                  | 騰       | 落         | 率        |             |           |             |                   |         |
| (期 首)<br>2021年1月25日 | 円<br>11,445      | %<br>—  | %<br>64.5 | %<br>3.5 | %<br>31.1   | %<br>0.7  |             |                   |         |
| 1月末                 | 11,296           | △ 1.3   | 65.0      | 3.6      | 31.6        | 0.8       |             |                   |         |
| 2月末                 | 11,519           | 0.6     | 66.7      | 2.4      | 31.0        | 0.8       |             |                   |         |
| 3月末                 | 12,048           | 5.3     | 66.1      | 3.3      | 30.9        | 0.8       |             |                   |         |
| 4月末                 | 12,130           | 6.0     | 62.0      | 4.4      | 33.7        | 0.8       |             |                   |         |
| 5月末                 | 12,260           | 7.1     | 62.7      | 3.8      | 33.7        | 0.7       |             |                   |         |
| 6月末                 | 12,401           | 8.4     | 63.4      | 3.2      | 33.5        | 0.8       |             |                   |         |
| 7月末                 | 12,395           | 8.3     | 62.3      | 3.7      | 34.2        | 0.7       |             |                   |         |
| 8月末                 | 12,615           | 10.2    | 62.3      | 3.6      | 33.3        | 0.7       |             |                   |         |
| 9月末                 | 12,679           | 10.8    | 63.7      | 2.7      | 33.6        | 0.7       |             |                   |         |
| 10月末                | 12,940           | 13.1    | 63.5      | 3.0      | 33.4        | 0.8       |             |                   |         |
| 11月末                | 12,751           | 11.4    | 61.0      | 4.7      | 34.4        | 0.7       |             |                   |         |
| 12月末                | 13,078           | 14.3    | 63.8      | 3.4      | 33.1        | 0.8       |             |                   |         |
| (期 末)<br>2022年1月25日 | 12,487           | 9.1     | 61.6      | 2.3      | 35.1        | 0.7       |             |                   |         |

(注) 謄落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

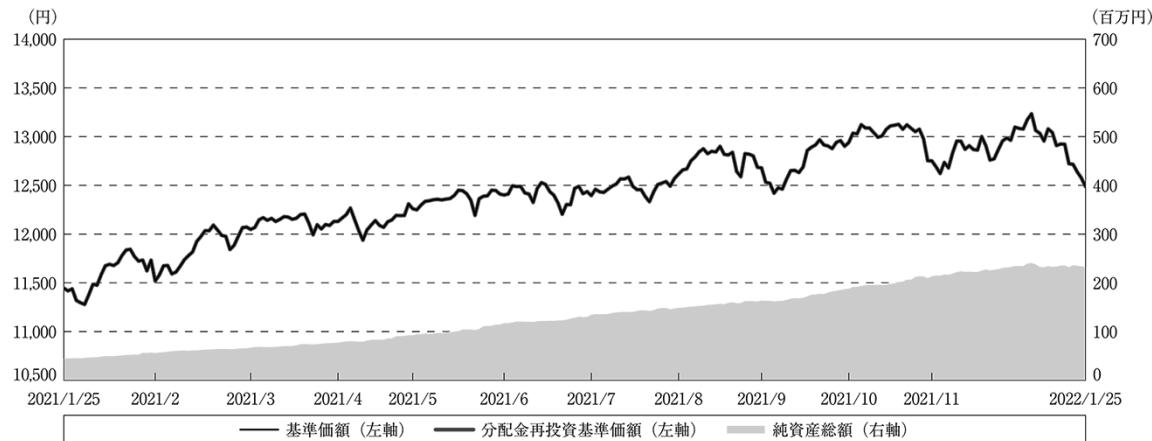
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指標もないため、ベンチマーク、参考指標を記載していません。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## ■期中の基準価額等の推移



期 首：11,445円

期 末：12,487円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率： 9.1%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）分配金再投資基準価額は、期首（2021年1月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

## ◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国の1.9兆米ドル規模の追加経済対策の成立やインフラ投資法案への取り組み
- ・新型コロナウイルスワクチン接種の進展による経済活動再開への期待
- ・米国の事前予想を上回る企業決算や堅調な経済指標

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの新たな変異株（オミクロン株）の感染拡大
- ・インフレ懸念などを背景とした主要国の金融政策正常化へ向けた動き

## ■投資環境

### 【国内株式市場】

期初、米国の大規模な財政支援策や各国の緩和的な金融政策、新型コロナウイルスワクチン接種の進展などから国内株式市場は上昇しましたが、期央にかけては新型コロナウイルスの感染が再拡大したことでもみ合い相場が続きました。期後半に入り、菅首相の退陣表明を受けて国内株式市場は大きく上昇しましたが、岸田新政権の政策への期待が後退したことや、エネルギー価格の上昇によるインフレ懸念などから下落に転じました。その後、国内の新型コロナウイルス新規感染者数が減少し経済活動再開への期待から国内株式市場は再び上昇しました。期末にかけては、オミクロン株の感染拡大への警戒感や米国における金融引き締め観測などから国内株式市場は下落基調となりましたが、前期末比では上昇して期を終えました。

### 【国内債券市場】

期初、0.04%程度であった10年国債利回りは、日銀の緩和的な金融政策継続に対する不透明感などを背景に2021年2月下旬にかけて上昇しましたが、3月の日銀金融政策決定会合後は、緩和的な金融政策が継続するとの見方が大勢を占めたことから低下基調で推移しました。期半ば以降は、インフレ懸念などを背景に主要国で金融政策の正常化に向けた動きが意識され国債利回りが上昇するなか、10年国債利回りも上昇し、0.14%程度の水準で期を終えました。

### 【外国株式市場】

期前半は、米国における1.9兆米ドル規模の追加経済対策の成立やインフラ投資法案への取り組みなどから景気回復期待が高まったほか、事前予想を上回る企業決算や堅調な経済指標などを背景に、外国株式市場は上昇しました。期後半は、引き続き堅調な企業決算や経済指標などが好感された一方、米国の債務上限問題やオミクロン株の感染拡大に対する懸念のほか、FRB（米連邦準備制度理事会）が金融政策の正常化に舵を切ったことなどが嫌気されて外国株式市場は上下しましたが、前期末比では上昇して期を終えました。

### 【外国債券市場】

米国債利回りは、バイデン米政権による大規模な財政支援策などを受けて2021年3月末にかけて上昇しましたが、その後は新型コロナウイルスの感染拡大などを背景に、期半ばにかけて低下基調で推移しました。期後半は、FRBによるテーパリング（量的緩和の縮小）の開始や2022年以降の利上げを織り込むかたちで米国債利回りは再び上昇基調となり、期初から上昇して期を終えました。

ドイツ国債利回りは、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展やインフレ懸念などを背景に、期半ばにかけて上昇基調で推移しました。その後、欧州での新型コロナウイルスの感染拡大を受けてドイツ国債利回りは低下する場面もありましたが、期末にかけては世界的に金融政策の正常化へ向けた動きが意識されるなか、ECB（欧州中央銀行）による利上げも織り込むかたちで上昇し、期初から上昇して期を終えました。

### 【為替市場】

米ドル円相場は、米国における大規模な財政支援策の成立などを背景に円安米ドル高基調で推移しました。期半ば以降、米ドル円相場はおおむね安定的に推移しましたが、期末にかけて米国債利回りが上昇するなか円安米ドル高が一段と進行しました。

ユーロ円相場は、新型コロナウイルスのワクチン接種が進展するなか、欧州域内における景気回復期待の高まりなどから円安ユーロ高が進行しました。

## ■ポートフォリオについて

### <東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055>

国内外の複数の資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券）を主要投資対象とするマザーファンドを、それぞれの資産配分比率に応じて組み入れました。各マザーファンドの値動きによって生じる組入比率の変動に対し、資産配分からの乖離の修正を適宜行い、期を通じて各資産の資産配分を維持しました。

当期中の資産配分比率は以下の通りです。なお、所定の運用方針に則り、期中に基本資産配分比率を変更しました。

### 【資産配分比率】

| 資産   | マザーファンド              | 資産配分比率       |             |
|------|----------------------|--------------|-------------|
|      |                      | 2021年3月31日まで | 2021年4月1日以降 |
| 国内株式 | TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 34%          | 33%         |
| 国内債券 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 22%          | 24%         |
| 外国株式 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 34%          | 33%         |
| 外国債券 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 10%          | 10%         |

以上の運用の結果、当ファンドの基準価額は、各マザーファンドの値動きを反映し、9.1%上昇しました。

### < TMA日本株TOPIXマザーファンド >

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は4.4%上昇し、株式配当などの要因を除くとベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

### < TMA日本債券インデックスマザーファンド >

ベンチマークであるNOMURA-BPI(総合)に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は0.3%下落し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

### < TMA外国株式インデックスマザーファンド >

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は23.5%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

### < TMA外国債券インデックスマザーファンド >

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は2.8%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

## ■分配金

当期においては、運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかつた収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

## ◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項<br>目             | 第3期                       |
|--------------------|---------------------------|
|                    | 2021年1月26日～<br>2022年1月25日 |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | —<br>—%                   |
| 当期の収益              | —                         |
| 当期の収益以外            | —                         |
| 翌期繰越分配対象額          | 2,487                     |

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの收益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ○今後の運用方針

---

### <東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055>

引き続き、国内外の複数の資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券）を主要投資対象とするマザーファンドを、それぞれの資産配分比率に応じて組み入れ、各マザーファンドの値動きによって生じる組入比率の変動に対し、資産配分からの乖離の修正を適宜行い、期を通じて各資産の資産配分を維持する運用を行います。

### <TMA日本株TOPIXマザーファンド>

### <TMA日本債券インデックスマザーファンド>

### <TMA外国株式インデックスマザーファンド>

### <TMA外国債券インデックスマザーファンド>

引き続き、上記4つのマザーファンドとも各々のベンチマークに連動する運用成果をめざして運用を行います。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

| 項目                    | 当期    |         | 項目の概要   |
|-----------------------|-------|---------|---|
|                       | 金額    | 比率      |   |
| (a) 信託報酬              | 円 38  | % 0.308 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>＊委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価              |
| (投信会社)                | (18)  | (0.143) |   |
| (販売会社)                | (18)  | (0.143) | *購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価                      |
| (受託会社)                | ( 3 ) | (0.022) | *運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価   |
| (b) 売買委託手数料           | 1     | 0.008   | (b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>＊売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株式)                  | ( 1 ) | (0.005) |   |
| (投資信託証券)              | ( 0 ) | (0.000) |   |
| (先物・オプション)            | ( 0 ) | (0.003) |   |
| (c) 有価証券取引税           | 1     | 0.006   | (c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>＊有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (株式)                  | ( 1 ) | (0.006) |   |
| (投資信託証券)              | ( 0 ) | (0.000) |   |
| (d) その他の費用            | 3     | 0.027   | (d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  |
| (保管費用)                | ( 2 ) | (0.014) | *保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用                    |
| (監査費用)                | ( 1 ) | (0.011) | *監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用   |
| (その他の)                | ( 0 ) | (0.002) | *その他は、信託事務等に要する諸費用  |
| 合計                    | 43    | 0.349   |   |
| 期中の平均基準価額は、12,342円です。 |       |         |   |

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

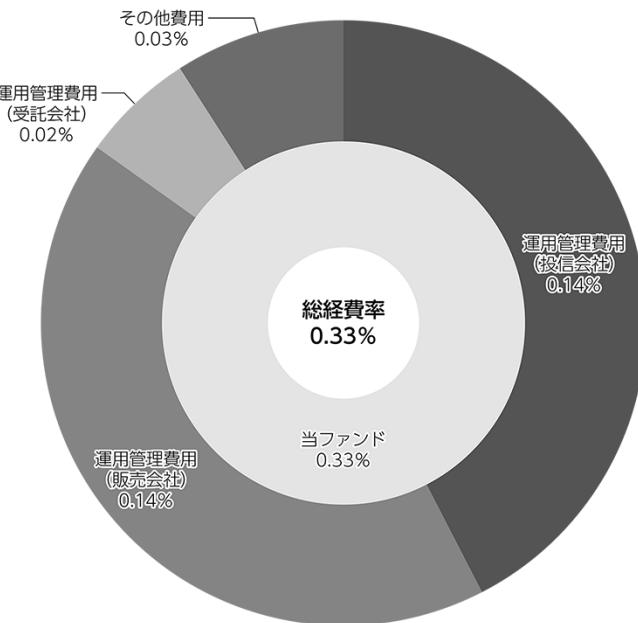
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

## ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.33%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄                   | 設定期          |              | 解約          |              |
|----------------------|--------------|--------------|-------------|--------------|
|                      | 口数           | 金額           | 口数          | 金額           |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 千口<br>46,059 | 千円<br>78,369 | 千口<br>9,269 | 千円<br>15,854 |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 44,742       | 57,971       | 6,894       | 8,932        |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 19,551       | 73,865       | 5,314       | 20,419       |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 13,362       | 23,112       | 2,027       | 3,513        |

## ○株式売買比率

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目                  | 当期                     |                          |
|---------------------|------------------------|--------------------------|
|                     | TMA日本株TOPIX<br>マザーファンド | TMA外国株式インデックス<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 13,778,171千円           | 23,335,901千円             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 37,134,622千円           | 46,668,384千円             |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.37                   | 0.50                     |

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt; TMA日本株TOPIXマザーファンド &gt;

| 種類 | 買付額       | 売付額       | 当期末保有額     |
|----|-----------|-----------|------------|
| 株式 | 百万円<br>46 | 百万円<br>41 | 百万円<br>315 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 親投資信託残高

| 銘 柄                  | 期首(前期末)     | 当 期 末        |              |
|----------------------|-------------|--------------|--------------|
|                      | 口 数         | 口 数          | 評 価 額        |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 千口<br>9,625 | 千口<br>46,416 | 千円<br>76,832 |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 7,381       | 45,230       | 58,374       |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 4,875       | 19,112       | 73,894       |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 2,578       | 13,913       | 23,957       |

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

| 項 目                  | 当 期 末        |           |
|----------------------|--------------|-----------|
|                      | 評 価 額        | 比 率       |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 千円<br>76,832 | %<br>32.7 |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 58,374       | 24.9      |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 73,894       | 31.5      |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 23,957       | 10.2      |
| コール・ローン等、その他         | 1,569        | 0.7       |
| 投資信託財産総額             | 234,626      | 100.0     |

(注) TMA 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（63,746,196千円）の投資信託財産総額（64,081,135千円）に対する比率は99.5%です。

(注) TMA 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,215,806千円）の投資信託財産総額（10,277,666千円）に対する比率は99.4%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=114.01円、1カナダドル=90.23円、1メキシコペソ=5.5334円、1ユーロ=129.06円、1英ポンド=153.70円、1イスラエル・ペソ=124.68円、1スウェーデンクローナ=12.30円、1ノルウェークローネ=12.69円、1デンマーククローネ=17.33円、1ポーランドズロチ=28.2676円、1豪ドル=81.65円、1ニュージーランドドル=76.35円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=84.86円、1マレーシアリンギット=27.2221円、1イスラエルシェケル=36.0642円、1オフショア元=18.0078円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年1月25日現在）

| 項目                        | 当期末          |
|---------------------------|--------------|
| (A) 資産                    | 円            |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)   | 234,626,941  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 76,832,906   |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 58,374,094   |
| TMA外國債券インデックスマザーファンド(評価額) | 73,894,799   |
| 未収入金                      | 23,957,805   |
| (B) 負債                    | 1,567,337    |
| 未払解約金                     | 1,552,566    |
| 未払信託報酬                    | 1,255,090    |
| その他未払費用                   | 287,309      |
| (C) 純資産総額(A-B)            | 10,167       |
| 元本                        | 233,074,375  |
| 次期繰越損益金                   | 186,650,843  |
| (D) 受益権総口数                | 46,423,532   |
| 1万口当たり基準価額(C/D)           | 186,650,843円 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)           | 12,487円      |

(注) 当ファンドの期首元本額は38,795,715円、期中追加設定元本額は173,994,786円、期中一部解約元本額は26,139,658円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

## ○損益の状況（2021年1月26日～2022年1月25日）

| 項目             | 当期末           |
|----------------|---------------|
| (A) 有価証券売買損益   | 円             |
| 売買益            | 2,504,039     |
| 売買損            | 5,719,627     |
| (B) 信託報酬等      | △ 3,215,588   |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 423,692     |
| (D) 前期繰越損益金    | 2,080,347     |
| (E) 追加信託差損益金   | 2,618,157     |
| (F) 計(C+D+E)   | 41,725,028    |
| (G) 収益分配金      | ( 23,323,032) |
| 次期繰越損益金(F+G)   | ( 18,401,996) |
| 追加信託差損益金       | 46,423,532    |
| (H) 分配準備積立金    | 0             |
| 分配準備積立金        | 46,423,532    |
| (I) 配当等相当額     | 41,725,028    |
| (J) (売買損益相当額)  | ( 23,530,548) |
| (K) (売買損益相当額)  | ( 18,194,480) |
| (L) 分配準備積立金    | 4,698,504     |

(注) (A) 有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| 項目                  | 当期末         |
|---------------------|-------------|
| a. 配当等収益(費用控除後)     | 1,611,242円  |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後)  | 469,105円    |
| c. 信託約款に規定する収益調整金   | 41,725,028円 |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 2,618,157円  |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)  | 46,423,532円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)   | 2,487円      |
| g. 分配金              | 0円          |
| h. 分配金(1万口当たり)      | 0円          |

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

## 運用報告書 第21期（決算日 2021年3月22日）

(計算期間 2020年3月24日～2021年3月22日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額     | ベンチマーク |            | 株組入比率  | 株先物比率  | 純資産額             |
|-----------------|----------|--------|------------|--------|--------|------------------|
|                 |          | 期騰落率   | 中率         |        |        |                  |
| 17期(2017年3月21日) | 円 12,166 | % 16.6 | % 1,563.42 | % 14.1 | % 97.2 | % 2.1 百万円 79,920 |
| 18期(2018年3月20日) | 13,619   | 11.9   | 1,716.29   | 9.8    | 93.8   | 6.2 68,511       |
| 19期(2019年3月20日) | 13,116   | △ 3.7  | 1,614.39   | △ 5.9  | 94.9   | 4.8 40,598       |
| 20期(2020年3月23日) | 10,786   | △17.8  | 1,292.01   | △20.0  | 92.3   | 5.2 24,339       |
| 21期(2021年3月22日) | 16,985   | 57.5   | 1,990.18   | 54.0   | 92.3   | 9.4 36,847       |

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）です。

TOPIXの指数值及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数值の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数值の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数值の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数值及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数值について、何ら保証、言及をするものではありません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数值及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数值の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数值を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日         | 基<br>準<br>価<br>額 | 騰<br>落<br>率 | ベ<br>ン<br>チ<br>マ<br>ー<br>ク |          | 株<br>組<br>入<br>比 | 株<br>先<br>物<br>比 | 式<br>率   |
|---------------------|------------------|-------------|----------------------------|----------|------------------|------------------|----------|
|                     |                  |             | 騰                          | 落        |                  |                  |          |
| (期 首)<br>2020年3月23日 | 円<br>10,786      | %<br>—      |                            | 1,292.01 | %<br>—           | %<br>92.3        | %<br>5.2 |
| 3月末                 | 11,852           | 9.9         | 1,403.04                   | 8.6      | 92.7             | 92.7             | 7.6      |
| 4月末                 | 12,351           | 14.5        | 1,464.03                   | 13.3     | 91.5             | 91.5             | 8.7      |
| 5月末                 | 13,187           | 22.3        | 1,563.67                   | 21.0     | 91.3             | 91.3             | 8.8      |
| 6月末                 | 13,162           | 22.0        | 1,558.77                   | 20.6     | 95.4             | 95.4             | 4.8      |
| 7月末                 | 12,632           | 17.1        | 1,496.06                   | 15.8     | 94.4             | 94.4             | 5.8      |
| 8月末                 | 13,655           | 26.6        | 1,618.18                   | 25.2     | 95.3             | 95.3             | 5.0      |
| 9月末                 | 13,827           | 28.2        | 1,625.49                   | 25.8     | 93.9             | 93.9             | 7.9      |
| 10月末                | 13,433           | 24.5        | 1,579.33                   | 22.2     | 93.6             | 93.6             | 6.6      |
| 11月末                | 14,921           | 38.3        | 1,754.92                   | 35.8     | 92.6             | 92.6             | 7.6      |
| 12月末                | 15,368           | 42.5        | 1,804.68                   | 39.7     | 96.3             | 96.3             | 3.9      |
| 2021年1月末            | 15,405           | 42.8        | 1,808.78                   | 40.0     | 92.0             | 92.0             | 8.2      |
| 2月末                 | 15,904           | 47.5        | 1,864.49                   | 44.3     | 95.6             | 95.6             | 4.6      |
| (期 末)<br>2021年3月22日 | 16,985           | 57.5        | 1,990.18                   | 54.0     | 92.3             | 92.3             | 9.4      |

(注) 謄落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ○運用経過

(2020年3月24日～2021年3月22日)

### ■期中の基準価額等の推移

期 首：10,786円  
期 末：16,985円  
騰落率： 57.5%

### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・主要各国による大規模な財政支援・金融緩和政策
- ・新型コロナウイルスワクチンの開発や普及による経済活動正常化への期待

#### マイナス要因

- ・米国大統領選挙などの政治的な不確実性
- ・財政支出の拡大や景気回復期待による米国長期金利の上昇



(注) ベンチマークは、期首（2020年3月23日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）です。

### ■投資環境

前期末に新型コロナウイルスの感染拡大による経済活動の停滞が懸念されて急落した国内株式市場は、主要各国が大規模な財政支援・金融緩和政策を行ったことから2020年6月にかけて回復基調をとどりました。その後は、11月の米国大統領選挙および連邦議会選挙を控えて政治的な不確実性が高まったことなどから、国内株式市場は方向感のない展開となりました。

期後半は、米国大統領選挙でバイデン民主党候補の勝利が確実となったことを受けて大型の財政出動への期待が高まったことや、欧米で新型コロナウイルスワクチンが承認され世界的に経済活動正常化への期待が高まったことなどから、国内株式市場は大きく上昇しました。米国の財政支出拡大や景気回復期待による長期金利の上昇が嫌気されて国内株式市場は弱含む局面もありましたが、米国の追加経済対策成立への期待から期末にかけて堅調に推移し、前期末対比上昇しました。

### ■ポートフォリオについて

日本の株式市場全体への投資を目的とし、TOPIX（東証株価指数）に連動した投資成果を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、市場でのウェイトが一定以上の銘柄についてはそのウェイト通り組み入れ、一定以下の銘柄については当社独自の業種分類と時価総額による規模分類に基づいて選定します。これにより、業種配分および企業規模などの特性がファンド全体でTOPIXとほぼ一致するよう調整しています。

期首の保有銘柄数は1,083銘柄でしたが、期中は設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、期末における保有銘柄数は1,078銘柄となりました。なお、実質的な株式の組入比率はほぼ100%に維持しました。

以上の運用の結果、基準価額は57.5%上昇しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+57.5%となり、ベンチマークの騰落率+54.0%にほぼ連動しました。

また、ベンチマークであるTOPIXからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>※</sup>は、過去1年で1.4%となりました。

### (主な差異要因)

#### プラス要因

- ・株式配当収益

#### マイナス要因

- ・特にありません

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。

## ○今後の運用方針

引き続き、基本方針に基づき、先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、TOPIXとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年3月24日～2021年3月22日)

| 項目                                | 当期                   |                                  | 項目の概要   |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------|---|
|                                   | 金額                   | 比率                               |   |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(先物・オプション) | 円<br>1<br>(0)<br>(1) | %<br>0.010<br>(0.000)<br>(0.010) | (a)売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>＊売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| 合計                                | 1                    | 0.010                            |   |
| 期中の平均基準価額は、13,808円です。             |                      |                                  |   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ○売買及び取引の状況

(2020年3月24日～2021年3月22日)

## 株式

|    |    | 買付                      |                        | 売付          |                 |
|----|----|-------------------------|------------------------|-------------|-----------------|
|    |    | 株数                      | 金額                     | 株数          | 金額              |
| 国内 | 上場 | 千株<br>3,205<br>(△1,316) | 千円<br>7,083,498<br>(—) | 千株<br>3,076 | 千円<br>7,702,431 |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ( ) 内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

## 先物取引の種類別取引状況

| 種類別       | 買建            |               | 売建         |            |
|-----------|---------------|---------------|------------|------------|
|           | 新規買付額         | 決済額           | 新規売付額      | 決済額        |
| 国内 株式先物取引 | 百万円<br>27,471 | 百万円<br>26,168 | 百万円<br>857 | 百万円<br>866 |

## ○株式売買比率

(2020年3月24日～2021年3月22日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目                  | 当期           |
|---------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額       | 14,785,929千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 28,494,057千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.51         |

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年3月24日～2021年3月22日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 買付額       | 売付額       | 当期末保有額     |
|----|-----------|-----------|------------|
| 株式 | 百万円<br>46 | 百万円<br>62 | 百万円<br>219 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2021年3月22日現在)

## 国内株式

| 銘<br>柄               | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |             |
|----------------------|---------|-------------|-------------|
|                      |         | 株<br>数      | 評<br>価<br>額 |
|                      | 千株      | 千株          | 千円          |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |             |             |
| 日本水産                 | 16      | 17          | 9,656       |
| マルハニチロ               | 2.5     | 2.9         | 7,969       |
| サカタのタネ               | 2       | 1.8         | 7,263       |
| ホクト                  | 1.9     | 2.4         | 5,251       |
| <b>鉱業 (0.2%)</b>     |         |             |             |
| 国際石油開発帝石             | 66.6    | 63.5        | 51,244      |
| 石油資源開発               | 2.3     | 2.2         | 4,881       |
| K&Oエナジーグループ          | 2.8     | 2.8         | 4,216       |
| <b>建設業 (2.4%)</b>    |         |             |             |
| ショーボンドホールディングス       | 2.2     | 2.3         | 11,304      |
| ミライ特・ホールディングス        | 4.3     | 4.7         | 8,901       |
| ペステラ                 | 3       | 3           | 5,427       |
| 安藤・間                 | 10.3    | 10.7        | 9,651       |
| 東急建設                 | 1.7     | 7.5         | 4,777       |
| コムシスホールディングス         | 5.9     | 6           | 20,190      |
| 東建コーポレーション           | 0.7     | 0.6         | 6,660       |
| ヤマウラ                 | 5.4     | 4.8         | 4,852       |
| 大成建設                 | 12.9    | 12.3        | 53,812      |
| 大林組                  | 39.2    | 39.5        | 41,751      |
| 清水建設                 | 40.2    | 40.3        | 37,599      |
| 長谷工コーポレーション          | 17.4    | 14.6        | 23,885      |
| 鹿島建設                 | 30.8    | 30          | 48,150      |
| 西松建設                 | 2.7     | 2.6         | 7,813       |
| 三井住友建設               | 10.3    | 11.6        | 6,240       |
| 前田建設工業               | 9.9     | 10.3        | 10,300      |
| 奥村組                  | 2.1     | 2.4         | 7,512       |
| 東鉄工業                 | 2       | 2.7         | 7,381       |
| 戸田建設                 | 17.5    | 18.4        | 15,934      |
| 熊谷組                  | 1.8     | 2.6         | 8,489       |
| 大東建託                 | 4.5     | 4.3         | 51,471      |
| NIPPO                | 3.6     | 3.6         | 10,908      |
| 前田道路                 | 4.1     | 2           | 4,486       |
| 東亜建設工業               | 3.8     | 2.8         | 7,168       |

| 銘<br>柄            | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |             |
|-------------------|---------|-------------|-------------|
|                   |         | 株<br>数      | 評<br>価<br>額 |
|                   | 千株      | 千株          | 千円          |
| 五洋建設              |         | 16.5        | 17,2        |
| 住友林業              |         | 9.3         | 9.8         |
| 日本基礎技術            |         | 0.5         | 5.7         |
| 大和ハウス工業           |         | 38.4        | 36.3        |
| 積水ハウス             |         | 42.5        | 42.4        |
| 北陸電気工事            |         | 4.4         | 4           |
| 中電工               |         | 2.4         | 2.2         |
| 関電工               |         | 6           | 6.3         |
| きんでん              |         | 9.2         | 9.4         |
| 日本電設工業            |         | 2.7         | 2.6         |
| 協和エクシオ            |         | 5           | 5.5         |
| 新日本空調             |         | 3.8         | 1.5         |
| 九電工               |         | 2.5         | 2.4         |
| 三機工業              |         | 5.1         | 4.2         |
| 日揮ホールディングス        |         | 11.9        | 12.3        |
| 中外炉工業             |         | 2.3         | 2.2         |
| ヤマト               |         | 6.5         | 6.5         |
| 高砂熱学工業            |         | 3.5         | 4.3         |
| 三晃金属工業            |         | 0.8         | 0.7         |
| 大氣社               |         | 1.8         | 3.2         |
| 日比谷総合設備           |         | 3.5         | 3.5         |
| O S J Bホールディングス   |         | 12.8        | 17.3        |
| 東洋エンジニアリング        |         | 2.6         | 5.6         |
| レイズネクスト           |         | 1.7         | 3.1         |
| <b>食料品 (3.3%)</b> |         |             |             |
| ニッパン              |         | 3.4         | 3.6         |
| 日清製粉グループ本社        |         | 13.8        | 14.5        |
| 鳥越製粉              |         | 6.3         | 6           |
| 日本甜菜製糖            |         | 3           | 3           |
| 三井製糖              |         | 0.6         | 2           |
| 森永製菓              |         | 3           | 3           |
| 江崎グリコ             |         | 3.4         | 3.4         |
| 山崎製パン             |         | 10.2        | 10          |
| 亀田製菓              |         | 1.1         | 1           |

| 銘<br>柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |       |
|--------------------------|---------|-------|---------|-------|
|                          |         | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                          | 千株      | 千株    | 千円      |       |
| 寿スピリッツ                   | 1.3     | 1.1   | 8,448   |       |
| カルビー                     | 5.6     | 5.6   | 16,665  |       |
| 森永乳業                     | 2.5     | 2.3   | 12,811  |       |
| ヤクルト本社                   | 8.5     | 8.6   | 49,880  |       |
| 明治ホールディングス               | 8.2     | 8.2   | 59,204  |       |
| 雪印メグミルク                  | 2.7     | 2.6   | 6,065   |       |
| ブリマハム                    | 2.3     | 2.1   | 7,612   |       |
| 日本ハム                     | 4.8     | 4.8   | 23,568  |       |
| 丸大食品                     | 2.2     | 2.9   | 5,185   |       |
| S Foods                  | 2.2     | 2.5   | 9,425   |       |
| 伊藤ハム米久ホールディングス           | 9       | 9.6   | 7,353   |       |
| サッポロホールディングス             | 4.3     | 4.3   | 10,117  |       |
| アサヒグループホールディングス          | 26      | 27.3  | 129,101 |       |
| キリンホールディングス              | 52.8    | 53.1  | 115,731 |       |
| 宝ホールディングス                | 9.4     | 9.6   | 14,208  |       |
| オエノンホールディングス             | 10.4    | 10.4  | 4,232   |       |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 9.4     | 9.3   | 19,585  |       |
| サントリー食品インターナショナル         | 8.3     | 8.3   | 34,403  |       |
| ダイドーグループホールディングス         | 0.9     | 1.1   | 6,259   |       |
| 伊藤園                      | 3.7     | 3.7   | 25,752  |       |
| キーコーヒー                   | 1.9     | 1.7   | 3,860   |       |
| ユニカフエ                    | 4       | 3.6   | 3,708   |       |
| ジャパンフーズ                  | 3.8     | 3.8   | 5,000   |       |
| 日清オイリオグループ               | 1.8     | 1.9   | 6,536   |       |
| 不二製油グループ本社               | 2.9     | 2.8   | 8,834   |       |
| J-オイルミルズ                 | 0.8     | 0.6   | 2,499   |       |
| キッコーマン                   | 8.9     | 9     | 58,410  |       |
| 味の素                      | 27.4    | 30.1  | 70,464  |       |
| キューピー                    | 6.8     | 7     | 17,815  |       |
| ハウス食品グループ本社              | 4.4     | 4.3   | 16,211  |       |
| カゴメ                      | 4.7     | 4.7   | 16,755  |       |
| アリアケジャパン                 | 1.1     | 0.8   | 5,400   |       |
| ニチレイ                     | 6.3     | 6.4   | 18,361  |       |
| 東洋水産                     | 6.3     | 6.4   | 30,208  |       |
| 日清食品ホールディングス             | 5.3     | 4.9   | 40,474  |       |
| フジッコ                     | 2.2     | 3.5   | 7,066   |       |
| ロック・フィールド                | 4.2     | 3.1   | 5,366   |       |
| 日本たばこ産業                  | 71.5    | 67.1  | 142,386 |       |

| 銘<br>柄         | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |       |
|----------------|---------|-------|---------|-------|
|                |         | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                | 千株      | 千株    | 千円      |       |
| ユーグレナ          | 7.8     | 5.2   | 5,720   |       |
| 織維製品 (0.5%)    |         |       |         |       |
| 片倉工業           | 4.6     | 4.4   | 6,388   |       |
| グンゼ            | 0.5     | 1.1   | 4,565   |       |
| 東洋紡            | 5       | 5.1   | 7,787   |       |
| 倉敷紡績           | 1.9     | 1.9   | 3,931   |       |
| 日本毛織           | 6.2     | 7     | 7,182   |       |
| 帝国織維           | 2.1     | 2.2   | 4,811   |       |
| 帝人             | 9.4     | 11.4  | 22,720  |       |
| 東レ             | 86.6    | 89.5  | 66,247  |       |
| 日本フエルト         | 9.2     | 8     | 3,768   |       |
| セーレン           | 2.9     | 3.5   | 7,528   |       |
| 小松マデーレ         | 7.2     | 5.2   | 5,402   |       |
| ワコールホールディングス   | 3.1     | 3.2   | 8,060   |       |
| ホギメディカル        | 1.5     | 2.2   | 7,700   |       |
| T S I ホールディングス | 4.5     | 9.8   | 3,283   |       |
| 三陽商会           | 2.8     | —     | —       |       |
| オンワードホールディングス  | 7.8     | —     | —       |       |
| ゴールドウイン        | 2.1     | 1.9   | 13,832  |       |
| デサント           | 3.5     | 3.5   | 6,877   |       |
| バルプ・紙 (0.3%)   |         |       |         |       |
| 特種東海製紙         | 1.2     | 1.1   | 5,698   |       |
| 王子ホールディングス     | 52      | 54.4  | 40,364  |       |
| 日本製紙           | 5.5     | 5.5   | 7,898   |       |
| 三菱製紙           | 2.6     | 6.3   | 2,557   |       |
| 北越コーポレーション     | 5.6     | 12.5  | 6,925   |       |
| 大王製紙           | 5.5     | 5.6   | 10,600  |       |
| レンゴー           | 12.4    | 12.8  | 12,851  |       |
| ザ・パック          | 1.3     | 1     | 3,165   |       |
| 化学 (7.3%)      |         |       |         |       |
| クラレ            | 20.5    | 20.4  | 27,274  |       |
| 旭化成            | 80.7    | 81.2  | 109,295 |       |
| 共和レザー          | 4.8     | 4.2   | 3,469   |       |
| 昭和電工           | 8.7     | 9     | 28,935  |       |
| 住友化学           | 93.8    | 99.9  | 58,341  |       |
| 日産化学           | 6.7     | 6.7   | 40,066  |       |
| クレハ            | 1.1     | 1     | 8,200   |       |
| 石原産業           | 0.6     | 6.7   | 6,351   |       |

| 銘<br>柄         | 期首(前期末) | 当期末    |         |             |
|----------------|---------|--------|---------|-------------|
|                |         | 株<br>数 | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                | 千株      | 千株     | 千円      |             |
| 片倉コープアグリ       | 3.6     | 3.6    | 5,022   |             |
| 日本曹達           | 2.1     | 1.7    | 6,417   |             |
| 東ソー            | 18.8    | 19.1   | 41,981  |             |
| トクヤマ           | 3.1     | 3.1    | 8,974   |             |
| セントラル硝子        | 2.5     | 2.5    | 6,025   |             |
| 東亜合成           | 7.7     | 7.8    | 10,717  |             |
| 大阪ソーダ          | 1.9     | 1.8    | 4,910   |             |
| デンカ            | 4.5     | 4.4    | 19,712  |             |
| 信越化学工業         | 20.8    | 22.6   | 413,015 |             |
| 堺化学工業          | 2.1     | 2.6    | 5,670   |             |
| エア・ウォーター       | 9.9     | 10.9   | 22,759  |             |
| 日本酸素ホールディングス   | 10.7    | 11.2   | 23,598  |             |
| 日本バーカライジング     | 6.3     | 6.4    | 7,916   |             |
| ステラ ケミファ       | 1.2     | 1.2    | 4,014   |             |
| 日本触媒           | 2.1     | 1.8    | 12,006  |             |
| カネカ            | 2.9     | 2.9    | 14,413  |             |
| 三菱瓦斯化学         | 12.2    | 11.9   | 33,474  |             |
| 三井化学           | 11      | 10.7   | 39,269  |             |
| J S R          | 12.5    | 12.3   | 42,435  |             |
| 東京応化工業         | 1.9     | 1.7    | 11,322  |             |
| 三菱ケミカルホールディングス | 80.9    | 82.6   | 72,663  |             |
| KHネオケム         | 2.1     | 1.8    | 5,342   |             |
| ダイセル           | 18.6    | 17.3   | 15,397  |             |
| 住友ベークライト       | 1.8     | 1.5    | 7,215   |             |
| 積水化学工業         | 26.1    | 26     | 56,186  |             |
| 日本ゼオン          | 11      | 11.5   | 20,033  |             |
| アイカ工業          | 3.3     | 3.3    | 13,464  |             |
| 宇部興産           | 6       | 6.1    | 15,524  |             |
| 旭有機材           | 2.8     | 2.8    | 4,446   |             |
| 日立化成           | 5.6     | —      | —       |             |
| タイガースポリマー      | 4.6     | 5.6    | 2,878   |             |
| ミライアル          | 2.8     | 2.8    | 3,472   |             |
| 日本化薬           | 7.2     | 7.3    | 8,322   |             |
| A D E K A      | 5.6     | 5.6    | 11,692  |             |
| 日油             | 4.6     | 4.5    | 25,920  |             |
| ハリマ化成グループ      | 4.7     | 4.7    | 4,765   |             |
| 花王             | 29.6    | 29.9   | 215,549 |             |
| ニイタカ           | 0.7     | 1.7    | 4,953   |             |

| 銘<br>柄             | 期首(前期末) | 当期末    |         |             |
|--------------------|---------|--------|---------|-------------|
|                    |         | 株<br>数 | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                    | 千株      | 千株     | 千円      |             |
| 三洋化成工業             | 3.8     | 1.1    | 6,435   |             |
| 日本ペイントホールディングス     | 10      | 10.1   | 87,668  |             |
| 関西ペイント             | 13.6    | 13.8   | 40,006  |             |
| 中国塗料               | 2.6     | 6.4    | 6,540   |             |
| 太陽ホールディングス         | 1.9     | 0.7    | 4,340   |             |
| D I C              | 5.3     | 5.3    | 15,794  |             |
| サカタインクス            | 3.5     | 3.8    | 4,233   |             |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 2.4     | 2.5    | 5,285   |             |
| 富士フイルムホールディングス     | 23.7    | 22     | 146,300 |             |
| 資生堂                | 24.6    | 24.8   | 191,803 |             |
| ライオン               | 16.1    | 16.3   | 36,740  |             |
| 高砂香料工業             | 1.3     | 2.1    | 5,670   |             |
| マンダム               | 2.8     | 2.8    | 6,042   |             |
| ミルボン               | 1.5     | 1.4    | 8,778   |             |
| ファンケル              | 5.4     | 5.3    | 20,458  |             |
| コーセー               | 2.3     | 2.3    | 38,939  |             |
| コタ                 | 4.2     | 4.1    | 7,654   |             |
| ボーラ・オルビスホールディングス   | 5       | 5      | 13,505  |             |
| ノエビアホールディングス       | 0.9     | 0.8    | 4,280   |             |
| エステー               | 2.9     | 2.8    | 5,692   |             |
| 長谷川香料              | 2.8     | 2.7    | 5,691   |             |
| 小林製薬               | 3.5     | 3.5    | 36,575  |             |
| 荒川化学工業             | 4       | 4      | 5,452   |             |
| メック                | 5.1     | 1.9    | 4,164   |             |
| タカラバイオ             | 3       | 2.9    | 8,801   |             |
| アース製薬              | 1       | 0.6    | 3,930   |             |
| 大成ラミック             | 1.6     | 1.5    | 4,491   |             |
| クミアイ化成工業           | 10.5    | 6.7    | 7,189   |             |
| 日本農薬               | 4.3     | 6.3    | 3,584   |             |
| 日東電工               | 8.5     | 8      | 74,880  |             |
| レック                | 1.9     | 3.3    | 4,464   |             |
| 前澤化成工業             | 3.8     | 3.8    | 3,743   |             |
| エフピコ               | 1.3     | 2.2    | 9,834   |             |
| 天馬                 | 2.7     | 2.6    | 6,206   |             |
| 信越ボリマー             | 5.2     | 5      | 5,155   |             |
| ニフコ                | 4.7     | 4.6    | 18,837  |             |
| バルカー               | 1.6     | 1.7    | 3,791   |             |
| ユニー・チャーム           | 23.9    | 26.4   | 121,070 |             |

| 銘<br>柄           | 期首(前期末) | 当期末    |         |             |
|------------------|---------|--------|---------|-------------|
|                  |         | 株<br>数 | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                  | 千株      | 千株     | 千円      |             |
| 医薬品 (5.6%)       |         |        |         |             |
| 協和キリン            | 12.5    | 12.7   | 40,640  |             |
| 武田薬品工業           | 102.9   | 103.8  | 446,962 |             |
| アステラス製薬          | 108.4   | 108.2  | 193,407 |             |
| 大日本住友製薬          | 9.1     | 9.3    | 18,888  |             |
| 塩野義製薬            | 15.8    | 15.7   | 92,630  |             |
| あすか製薬            | 3.7     | 3.7    | 5,945   |             |
| 日本新薬             | 3.2     | 3.4    | 27,370  |             |
| 中外製薬             | 12.8    | 39     | 173,784 |             |
| 科研製薬             | 2.2     | 2      | 9,230   |             |
| エーザイ             | 14.8    | 13.8   | 103,541 |             |
| ロート製薬            | 6       | 6.2    | 19,220  |             |
| 小野薬品工業           | 28.6    | 28.7   | 84,306  |             |
| 久光製薬             | 3.3     | 3.5    | 26,005  |             |
| 持田製薬             | 1.6     | 1.3    | 6,103   |             |
| 参天製薬             | 23      | 23.5   | 36,777  |             |
| ツムラ              | 3.7     | 3.7    | 14,726  |             |
| 日医工              | 3.8     | 4.2    | 4,477   |             |
| キッセイ薬品工業         | 2.1     | 1.9    | 5,183   |             |
| 生化学工業            | 4.1     | 3.6    | 4,014   |             |
| 栄研化学             | 2.2     | 3.3    | 7,223   |             |
| 鳥居薬品             | 1.5     | 1.1    | 3,465   |             |
| J C R ファーマ       | 0.8     | 3.1    | 10,400  |             |
| 東和薬品             | 1.9     | 2.5    | 6,272   |             |
| 沢井製薬             | 2.3     | 2.3    | 12,466  |             |
| ゼリア新薬工業          | 3       | 3      | 6,684   |             |
| 第一三共             | 35.4    | 107.1  | 345,933 |             |
| キヨーリン製薬ホールディングス  | 3       | 2.9    | 6,005   |             |
| 大幸薬品             | 3.5     | 4.2    | 5,514   |             |
| 大塚ホールディングス       | 23.5    | 25.9   | 121,341 |             |
| 大正製薬ホールディングス     | 2.6     | 2.7    | 20,358  |             |
| ペプチドリーム          | 6.2     | 6.4    | 32,768  |             |
| 石油・石炭製品 (0.4%)   |         |        |         |             |
| ニチ雷キ             | 5.6     | 2.4    | 3,993   |             |
| 出光興産             | 13.9    | 14     | 41,062  |             |
| ENEOSホールディングス    | 186.6   | 184.6  | 95,050  |             |
| コスモエネルギーホールディングス | 3.3     | 3.4    | 9,248   |             |

| 銘<br>柄             | 期首(前期末) | 当期末    |         |             |
|--------------------|---------|--------|---------|-------------|
|                    |         | 株<br>数 | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                    | 千株      | 千株     | 千円      |             |
| ゴム製品 (0.6%)        |         |        |         |             |
| 横浜ゴム               | 6.8     | 7.1    | 13,411  |             |
| TOYO TIRE          | 6.6     | 6.7    | 13,158  |             |
| ブリヂストン             | 35.4    | 33.1   | 145,838 |             |
| 住友ゴム工業             | 10.8    | 11.3   | 13,808  |             |
| オカモト               | 0.7     | 0.9    | 3,991   |             |
| ニッタ                | 1.4     | 1.8    | 4,926   |             |
| 住友理工               | 4.3     | 8.5    | 6,222   |             |
| バンドー化成             | 3.7     | 5.8    | 4,744   |             |
| ガラス・土石製品 (0.8%)    |         |        |         |             |
| 日東紡績               | 1.6     | 1.4    | 5,957   |             |
| AGC                | 12.2    | 11.4   | 49,647  |             |
| 日本山村硝子             | 3.2     | 3.2    | 3,462   |             |
| 日本電気硝子             | 5.1     | 5      | 12,900  |             |
| 住友大阪セメント           | 2.3     | 2.2    | 8,228   |             |
| 太平洋セメント            | 7.6     | 7.8    | 23,400  |             |
| 日本ヒューム             | 6.4     | 6.4    | 5,056   |             |
| 東海カーボン             | 11.6    | 12.2   | 21,350  |             |
| 東洋炭素               | 3.4     | 2.6    | 5,647   |             |
| TOTO               | 8.8     | 8.9    | 59,719  |             |
| 日本碍子               | 14.8    | 15     | 31,455  |             |
| 日本特殊陶業             | 10.4    | 10.2   | 20,104  |             |
| ニチアス               | 3.1     | 3.1    | 9,086   |             |
| ニチハ                | 1.6     | 1.2    | 4,050   |             |
| 鉄鋼 (0.8%)          |         |        |         |             |
| 日本製鉄               | 54.9    | 59.1   | 114,151 |             |
| 神戸製鋼所              | 22.3    | 23.7   | 17,253  |             |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 32.9    | 33.8   | 47,894  |             |
| 東京製鐵               | 4.1     | 8.1    | 6,569   |             |
| 共立製鋼               | 1.4     | 3.4    | 5,899   |             |
| 大和工業               | 2.3     | 2.2    | 6,688   |             |
| 大阪製鐵               | 1.6     | 3.2    | 4,473   |             |
| 淀川製鋼所              | 2.3     | 2      | 5,124   |             |
| 丸一鋼管               | 4.2     | 4.2    | 11,138  |             |
| 大同特殊鋼              | 2       | 1.8    | 9,144   |             |
| 山陽特殊製鋼             | 0.1     | 4.9    | 8,315   |             |
| 愛知製鋼               | 0.6     | 1.3    | 4,693   |             |
| 日立金属               | 12.9    | 12.9   | 24,174  |             |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末  |        |     |
|--------------------|---------|------|--------|-----|
|                    |         | 株数   | 株数     | 評価額 |
|                    | 千株      | 千株   | 千円     |     |
| 大太平洋金属             | 0.9     | 1.3  | 2,886  |     |
| 新日本電工              | 12.7    | 22.4 | 7,078  |     |
| 三菱製鋼               | 3.8     | 3.2  | 2,953  |     |
| シンニッタン             | 8.3     | 9.4  | 2,876  |     |
| <b>非鉄金属 (0.8%)</b> |         |      |        |     |
| 日本軽金属ホールディングス      | 36.6    | 3.7  | 8,672  |     |
| 三井金属鉱業             | 3.3     | 3.2  | 12,272 |     |
| 東邦亜鉛               | 1.9     | 2.3  | 5,641  |     |
| 三菱マテリアル            | 7.7     | 8    | 20,552 |     |
| 住友金属鉱山             | 15.6    | 15.8 | 76,519 |     |
| DOWAホールディングス       | 2.6     | 2.6  | 12,467 |     |
| 古河機械金属             | 3.6     | 3.4  | 4,970  |     |
| UACJ               | 2.5     | 2.1  | 5,661  |     |
| 古河電気工業             | 3.2     | 3.2  | 9,728  |     |
| 住友電気工業             | 45.6    | 43.5 | 74,950 |     |
| フジクラ               | 12.9    | 14.8 | 8,243  |     |
| タツタ電線              | 7.1     | 7.1  | 4,671  |     |
| リヨービ               | 2.4     | 4.5  | 7,965  |     |
| アサヒホールディングス        | —       | 1.8  | 8,019  |     |
| <b>金属製品 (0.7%)</b> |         |      |        |     |
| トーカロ               | 3.2     | 4.4  | 6,604  |     |
| SUMCO              | 13.9    | 15.6 | 40,950 |     |
| 東洋製罐グループホールディングス   | 7.5     | 7.7  | 10,710 |     |
| コロナ                | 3.8     | 3.4  | 3,417  |     |
| 横河ブリッジホールディングス     | 2.9     | 2.7  | 5,502  |     |
| 駒井ハルティック           | 1.8     | 1.7  | 3,828  |     |
| 三和ホールディングス         | 12.1    | 12.6 | 18,622 |     |
| 文化シヤッター            | 3.3     | 5.6  | 6,059  |     |
| 三協立山               | 4.7     | 4.7  | 4,023  |     |
| LIXIL              | 18      | 17.3 | 55,446 |     |
| ノーリツ               | 6.9     | 4.9  | 9,334  |     |
| 長府製作所              | 2.2     | 2    | 4,472  |     |
| リンナイ               | 2       | 2.2  | 26,884 |     |
| 日東精工               | 9.1     | 9.1  | 5,541  |     |
| 東プレ                | 2.7     | 7.4  | 12,661 |     |
| 高周波熱鍊              | 3.8     | 4.8  | 3,168  |     |
| バイオラックス            | 2.8     | 4.5  | 7,888  |     |
| 日本発條               | 12.2    | 13   | 11,076 |     |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当期末  |         |     |
|------------------|---------|------|---------|-----|
|                  |         | 株数   | 株数      | 評価額 |
|                  | 千株      | 千株   | 千円      |     |
| 三益半導体工業          | 4.2     | 1.4  | 3,878   |     |
| <b>機械 (5.5%)</b> |         |      |         |     |
| 日本製鋼所            | 3.6     | 3.6  | 9,410   |     |
| 三浦工業             | 5       | 5.2  | 30,628  |     |
| タクマ              | 4.5     | 4.6  | 11,477  |     |
| オークマ             | 1.1     | 1.1  | 7,238   |     |
| 芝浦機械             | 0.4     | 2.7  | 8,167   |     |
| アマダ              | 16.3    | 19.6 | 25,480  |     |
| アイダエンジニアリング      | 5.7     | 5.4  | 5,394   |     |
| FUJI             | 4.1     | 4.5  | 12,190  |     |
| 牧野フライス製作所        | 1.3     | 1.4  | 6,545   |     |
| オーエスジー           | 5.9     | 6    | 12,420  |     |
| 旭ダイヤモンド工業        | 4.8     | 9.3  | 5,301   |     |
| DMG森精機           | 7.4     | 7.6  | 14,318  |     |
| ディスコ             | 1.5     | 1.6  | 54,080  |     |
| 日東工器             | 2.6     | 2.5  | 5,130   |     |
| 島精機製作所           | 1.6     | 2.1  | 5,651   |     |
| 日阪製作所            | 4.6     | 4.6  | 4,084   |     |
| ナブテスコ            | 7.3     | 7.2  | 36,144  |     |
| SMC              | 3.8     | 3.6  | 226,908 |     |
| ユニオンツール          | 1.8     | 1.3  | 4,667   |     |
| オイレス工業           | 2.2     | 2.1  | 3,777   |     |
| サトーホールディングス      | 0.1     | 3.8  | 10,708  |     |
| 小松製作所            | 56.2    | 56.5 | 191,591 |     |
| 住友重機械工業          | 6.7     | 7    | 22,085  |     |
| 日立建機             | 4.6     | 4.9  | 17,003  |     |
| 巴工業              | 2.4     | 2.3  | 4,917   |     |
| 井関農機             | 2.8     | 3.7  | 6,234   |     |
| タカキタ             | 6       | 5.5  | 3,910   |     |
| クボタ              | 65.8    | 65.6 | 161,966 |     |
| 月島機械             | 4.1     | 3.6  | 4,816   |     |
| 帝国電機製作所          | 3.9     | 3.3  | 4,544   |     |
| 新東工業             | 4.9     | 6.1  | 4,959   |     |
| 小森コーポレーション       | 4.5     | 4.9  | 3,748   |     |
| 鶴見製作所            | 3.2     | 3.2  | 5,689   |     |
| 荏原製作所            | 5.2     | 5.2  | 22,880  |     |
| 西島製作所            | 5.9     | 5.9  | 5,180   |     |
| ダイキン工業           | 15.7    | 15.9 | 353,298 |     |

| 銘<br>柄        | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |       |
|---------------|---------|-------|---------|-------|
|               |         | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|               | 千株      | 千株    | 千円      |       |
| 栗田工業          | 6.3     | 6.6   | 32,340  |       |
| 椿本チエイン        | 1.3     | 2     | 6,590   |       |
| ダイフク          | 6.3     | 6.9   | 71,208  |       |
| タダノ           | 5.8     | 4.1   | 5,194   |       |
| フジテック         | 4.9     | 4.9   | 12,279  |       |
| C K D         | 3.7     | 3.6   | 7,920   |       |
| 平和            | 3.2     | 3.3   | 6,530   |       |
| S A N K Y O   | 3       | 2.9   | 9,222   |       |
| 日本金銭機械        | 4.3     | 4.9   | 3,351   |       |
| フクシマガリレイ      | 1       | 1.4   | 6,335   |       |
| 竹内製作所         | 1.3     | 2.3   | 7,245   |       |
| アマノ           | 3.3     | 3.2   | 8,806   |       |
| グローリー         | 4       | 3.7   | 9,412   |       |
| 大和冷機工業        | 4.7     | 4.5   | 4,887   |       |
| セガサミーホールディングス | 12.3    | 12.9  | 22,704  |       |
| リケン           | 0.7     | 1.9   | 5,006   |       |
| ホシザキ          | 3.6     | 3.9   | 38,922  |       |
| 大豊工業          | 3.7     | 4.2   | 4,544   |       |
| 日本精工          | 25.9    | 25.2  | 29,282  |       |
| N T N         | 30.5    | 33    | 11,484  |       |
| ジェイテクト        | 12.1    | 12.6  | 14,628  |       |
| 不二越           | 1.2     | 1.7   | 8,474   |       |
| 日本トムソン        | 5       | 10.6  | 7,345   |       |
| T H K         | 7.7     | 7.5   | 27,825  |       |
| ユーション精機       | 4       | 4.1   | 3,911   |       |
| キツツ           | 7.1     | 6.6   | 4,382   |       |
| マキタ           | 16      | 16.2  | 78,327  |       |
| 日立造船          | 10.7    | 11.7  | 10,939  |       |
| 三菱重工業         | 20.8    | 19.8  | 71,141  |       |
| I H I         | 9.4     | 9.7   | 22,765  |       |
| スター精密         | 5.2     | 3.5   | 5,992   |       |
| 電気機器 (17.1%)  |         |       |         |       |
| 日清紡ホールディングス   | 7.1     | 7.5   | 6,510   |       |
| イビデン          | 7.3     | 6     | 29,940  |       |
| コニカミノルタ       | 27.3    | 29.2  | 17,899  |       |
| プラザー工業        | 15.3    | 15.3  | 38,234  |       |
| ミネベアミツミ       | 22.9    | 21.7  | 60,760  |       |
| 日立製作所         | 59.4    | 60.1  | 325,020 |       |

| 銘<br>柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |       |
|--------------------|---------|-------|---------|-------|
|                    |         | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |       |
| 東芝                 | —       | 18.7  | 72,743  |       |
| 三菱電機               | 123.2   | 124.7 | 216,915 |       |
| 富士電機               | 7.9     | 7.5   | 35,437  |       |
| 安川電機               | 13.4    | 13.4  | 71,422  |       |
| 明電舎                | 3.3     | 2.8   | 7,095   |       |
| 東芝テック              | 2.4     | 1.1   | 4,642   |       |
| マブチモーター            | 3.3     | 3.2   | 16,608  |       |
| 日本電産               | 14.9    | 30    | 399,000 |       |
| 東光高岳               | 3.2     | 3.2   | 5,388   |       |
| ダイヘン               | 1.6     | 1.4   | 6,741   |       |
| 日新電機               | 3       | 3.8   | 4,864   |       |
| オムロン               | 11.1    | 10.4  | 93,184  |       |
| 日東工業               | 2.5     | 2.4   | 5,126   |       |
| ジー・エス・ユアサ コーポレーション | 4.4     | 4.4   | 13,116  |       |
| メルコホールディングス        | 1.6     | 1.3   | 5,024   |       |
| テクノメディカ            | 1.8     | 1.8   | 3,171   |       |
| 日本電気               | 15      | 15.9  | 107,643 |       |
| 富士通                | 11.9    | 11.2  | 181,832 |       |
| 沖電気工業              | 5.2     | 5     | 6,115   |       |
| サンケン電気             | 2.4     | 1.8   | 9,306   |       |
| アイホン               | 2.8     | 2.8   | 5,238   |       |
| ルネサスエレクトロニクス       | 58.8    | 53.2  | 62,137  |       |
| セイコーエプソン           | 15.5    | 16.3  | 29,584  |       |
| ワコム                | 4.7     | 6.2   | 4,811   |       |
| アルパック              | 2.6     | 2.4   | 10,668  |       |
| E I Z O            | 1.2     | 3     | 13,200  |       |
| 日本信号               | 5.3     | 4.5   | 4,711   |       |
| 能美防災               | 2.1     | 2.3   | 5,352   |       |
| ホーチキ               | 3.5     | 3.5   | 5,246   |       |
| エレコム               | 1.3     | 1.1   | 5,687   |       |
| パナソニック             | 140.5   | 133.1 | 185,674 |       |
| シャープ               | 11.6    | 14    | 26,068  |       |
| アンリツ               | 8       | 8.3   | 20,293  |       |
| 富士通ゼネラル            | 4       | 3.7   | 11,285  |       |
| ソニー                | 77.9    | 78.1  | 895,026 |       |
| T D K              | 6       | 6     | 91,500  |       |
| アルプスアルバイン          | 10.8    | 11.3  | 16,904  |       |
| 日本トリム              | 0.1     | 0.6   | 2,574   |       |

| 銘<br>柄      | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|-------------|---------|-------------|---------|-------------|
|             |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|             | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| フォスター電機     | 3.4     | 3.4         | 4,763   |             |
| ヨコオ         | 2.4     | 2.1         | 6,291   |             |
| ホシデン        | 4.2     | 8.4         | 9,836   |             |
| ヒロセ電機       | 1.6     | 1.9         | 33,858  |             |
| 日本航空電子工業    | 3.5     | 3.7         | 6,815   |             |
| アイコム        | 2.2     | 1.9         | 5,654   |             |
| 船井電機        | 6.2     | 5.6         | 3,897   |             |
| 横河電機        | 12.6    | 11.9        | 25,132  |             |
| アズビル        | 8       | 8.5         | 41,352  |             |
| 日本光電工業      | 5.3     | 5.3         | 16,880  |             |
| 堀場製作所       | 2.4     | 2.3         | 16,468  |             |
| アドバンテスト     | 9.1     | 9.3         | 84,351  |             |
| キーエンス       | 11.2    | 12.2        | 611,464 |             |
| 日置電機        | 1.2     | 0.9         | 3,748   |             |
| シスメックス      | 8.8     | 9.7         | 111,647 |             |
| OBARA GROUP | 0.8     | 0.9         | 3,622   |             |
| ヨーセル        | 3.6     | 1.4         | 1,530   |             |
| イリソ電子工業     | 1.1     | 1           | 5,340   |             |
| オブテックシステム   | 3.5     | 3.2         | 5,555   |             |
| 千代田インテグレ    | 2.6     | 2.6         | 5,064   |             |
| レーザーテック     | 5.4     | 5.5         | 71,555  |             |
| スタンレー電気     | 8.3     | 8.8         | 29,788  |             |
| ウシオ電機       | 7.1     | 7.4         | 10,989  |             |
| 日本セラミック     | 1.3     | 1.9         | 5,149   |             |
| 図研          | 2.7     | 2.1         | 5,854   |             |
| 日本電子        | 2.5     | 2.4         | 9,516   |             |
| カシオ計算機      | 10.5    | 11          | 22,473  |             |
| ファナック       | 11.9    | 10.9        | 281,983 |             |
| ローム         | 5.5     | 5.2         | 55,432  |             |
| 浜松ホトニクス     | 8.8     | 8.9         | 59,185  |             |
| 三井ハイテック     | 3.5     | 1.6         | 7,176   |             |
| 新光電気工業      | 6.1     | 4.6         | 14,835  |             |
| 京セラ         | 17.4    | 19          | 140,828 |             |
| 太陽誘電        | 5       | 5.4         | 29,700  |             |
| 村田製作所       | 36.2    | 36.7        | 332,135 |             |
| 双葉電子工業      | 3       | 4.5         | 4,626   |             |
| ニチコン        | 1.8     | 4.6         | 5,354   |             |
| 日本ケミコン      | 1.7     | 2.3         | 4,537   |             |

| 銘<br>柄              | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |           |             |
|---------------------|---------|-------------|-----------|-------------|
|                     |         | 株<br>数      | 株<br>数    | 評<br>価<br>額 |
|                     | 千株      | 千株          | 千円        |             |
| K O A               | 3.3     | 2.9         | 4,642     |             |
| 小糸製作所               | 7.5     | 7.4         | 57,720    |             |
| ミツバ                 | 7.8     | 7.8         | 5,343     |             |
| S C R E E Nホールディングス | 2.1     | 1.9         | 17,119    |             |
| キヤノン電子              | 2.6     | 3.4         | 5,878     |             |
| キヤノン                | 66.4    | 62          | 147,839   |             |
| リコー                 | 32.1    | 34.2        | 40,321    |             |
| 象印マホービン             | 3.5     | 3.4         | 6,721     |             |
| 東京エレクトロン            | 8.2     | 7.3         | 302,950   |             |
| 輸送用機器 (7.2%)        |         |             |           |             |
| トヨタ紡織               | 3.9     | 3.6         | 6,656     |             |
| ユニプレス               | 2.3     | 6.3         | 7,522     |             |
| 豊田自動織機              | 10      | 10.1        | 100,596   |             |
| モリタホールディングス         | 2.6     | 2.8         | 5,031     |             |
| デンソー                | 27.2    | 27.5        | 202,125   |             |
| 東海理化電機製作所           | 2.5     | 3.2         | 6,281     |             |
| 川崎重工業               | 9.5     | 10          | 28,400    |             |
| 日産自動車               | 144.6   | 143.4       | 86,183    |             |
| いすゞ自動車              | 38.4    | 36.6        | 41,431    |             |
| トヨタ自動車              | 137.9   | 126.2       | 1,055,284 |             |
| 日野自動車               | 14.9    | 16.8        | 17,169    |             |
| 三菱自動車工業             | 45.6    | 48.6        | 14,871    |             |
| 武蔵精密工業              | 2.9     | 3.8         | 7,676     |             |
| 日産車体                | 3.3     | 4.7         | 4,046     |             |
| 新明和工業               | 5       | 4.5         | 4,819     |             |
| 極東開発工業              | 3       | 3           | 5,160     |             |
| 日信工業                | 4       | —           | —         |             |
| トピー工業               | 1.3     | 2.8         | 4,250     |             |
| ティラド                | 2.4     | 2.4         | 5,256     |             |
| NOK                 | 6.2     | 6.4         | 10,099    |             |
| フタバ産業               | 2.8     | 8.2         | 5,207     |             |
| K Y B               | 1.8     | 2.7         | 8,842     |             |
| プレス工業               | 8.3     | 18.4        | 6,513     |             |
| ケーヒン                | 2.9     | —           | —         |             |
| アイシン精機              | 10.2    | 9.3         | 37,572    |             |
| マツダ                 | 37      | 38.6        | 35,048    |             |
| 今仙電機製作所             | 6       | 6           | 4,950     |             |
| 本田技研工業              | 97.2    | 98.2        | 328,479   |             |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当期末  |         |        |
|-------------------|---------|------|---------|--------|
|                   |         | 株数   | 株数      | 評価額    |
| スズキ               | 千株      | 千株   | 千円      |        |
| SUBARU            | 24.5    | 24.7 | 115,596 |        |
| ヤマハ発動機            | 38.5    | 36   | 79,578  |        |
| ショーワ              | 16.2    | 17.6 | 47,396  |        |
| エクセディ             | 3.5     | —    | —       |        |
| 豊田合成              | 4.6     | 4.1  | 7,384   |        |
| 愛三工業              | 3.8     | 3.8  | 11,350  |        |
| ヨロズ               | 7.2     | 7.2  | 4,917   |        |
| エフ・シー・シー          | 3       | 3.8  | 5,270   |        |
| シマノ               | 2.4     | 2.7  | 5,316   |        |
| ティ・エス・テック         | 4.6     | 4.6  | 117,093 |        |
| 精密機器 (2.5%)       | 2.7     | 2.7  | 9,328   |        |
| テルモ               | 35.1    | 38.3 | 148,221 |        |
| クリエートメディック        | 4.4     | 4    | 4,080   |        |
| 島津製作所             | 14.9    | 16.2 | 63,342  |        |
| ブイ・テクノロジー         | 0.8     | 0.9  | 5,049   |        |
| 東京精密              | 2.2     | 2    | 10,380  |        |
| マニー               | 2.2     | 4.6  | 11,996  |        |
| ニコン               | 6.1     | 6.4  | 8,793   |        |
| トブコン              | 21.9    | 20.8 | 21,132  |        |
| オリンパス             | 68.4    | 69   | 162,736 |        |
| 理研計器              | 2.1     | 2.3  | 6,764   |        |
| タムロン              | 2.1     | 1.8  | 5,823   |        |
| HOYA              | 24.7    | 24.8 | 315,952 |        |
| 朝日インテック           | 10.4    | 13.3 | 41,097  |        |
| シチズン時計            | 10.4    | 15.3 | 7,262   |        |
| ミニコン              | 2.1     | 1.4  | 9,585   |        |
| セイコーホールディングス      | 6.1     | 2    | 4,836   |        |
| ニプロ               | 1.8     | 8.3  | 8.6     | 12,177 |
| その他製品 (2.4%)      | 1.3     | 1.3  | 6,292   |        |
| パラマウントベッドホールディングス | 12.8    | 10.2 | 81,049  |        |
| バンダイナムコホールディングス   | 5       | 4.4  | 3,361   |        |
| アイフィスジャパン         | 1.9     | 1.7  | 6,247   |        |
| パイロットコーポレーション     | 5.2     | 5.2  | 6,302   |        |
| トップパン・フォームズ       | 2.8     | 2.7  | 6,882   |        |
| フジシールインター・ナショナル   | 5.9     | 6.3  | 6,759   |        |
| タカラトミー            | 4.5     | 4.1  | 2,583   |        |

| 銘柄            | 期首(前期末) | 当期末   |         |     |
|---------------|---------|-------|---------|-----|
|               |         | 株数    | 株数      | 評価額 |
| 大建工業          | 千株      | 千株    | 千円      |     |
| 凸版印刷          | 5.6     | 3.2   | 7,248   |     |
| 大日本印刷         | 17.5    | 18.7  | 36,371  |     |
| NISSHA        | 16.2    | 15.5  | 37,479  |     |
| アシックス         | 4       | 4.2   | 6,077   |     |
| 小松ウォール工業      | 12.1    | 11    | 21,714  |     |
| ヤマハ           | 2.2     | 2.2   | 4,626   |     |
| クリナップ         | 7.3     | 7.4   | 45,066  |     |
| ビジョン          | 5.7     | 5.1   | 2,840   |     |
| キングジム         | 7.5     | 8     | 32,880  |     |
| リンテック         | 5.8     | 5.8   | 5,399   |     |
| イトーキ          | 2.5     | 2.5   | 6,560   |     |
| 任天堂           | 9.7     | 9.7   | 4,306   |     |
| 三菱鉛筆          | 7.6     | 7.1   | 447,158 |     |
| タカラスタンダード     | 3       | 4.8   | 8,174   |     |
| コクヨ           | 2.7     | 3.2   | 5,619   |     |
| オカムラ          | 5.5     | 5.6   | 10,040  |     |
| 美津濃           | 4.2     | 6.1   | 8,198   |     |
| 電気・ガス業 (1.4%) | 2.5     | 2.3   | 5,577   |     |
| 東京電力ホールディングス  | 98.6    | 108.3 | 40,179  |     |
| 中部電力          | 37.9    | 38.4  | 55,641  |     |
| 関西電力          | 47.7    | 47.6  | 58,952  |     |
| 中国電力          | 17.6    | 18.6  | 26,077  |     |
| 北陸電力          | 12.2    | 12.6  | 9,261   |     |
| 東北電力          | 30.4    | 32.1  | 35,021  |     |
| 四国電力          | 11.2    | 11.7  | 10,764  |     |
| 九州電力          | 25.4    | 27    | 29,997  |     |
| 北海道電力         | 12.8    | 12.8  | 6,720   |     |
| 沖縄電力          | 2.1     | 3.1   | 4,978   |     |
| 電源開発          | 9.7     | 10.1  | 19,674  |     |
| レノバ           | —       | 1.8   | 5,760   |     |
| 東京瓦斯          | 23.9    | 24.1  | 60,177  |     |
| 大阪瓦斯          | 23.9    | 23.4  | 51,152  |     |
| 東邦瓦斯          | 6       | 6.1   | 41,175  |     |
| 北海道瓦斯         | 3.5     | 3.2   | 5,283   |     |
| 西部瓦斯          | 2.2     | 2.1   | 6,688   |     |
| 静岡ガス          | 5.9     | 5.6   | 5,476   |     |

| 銘<br>柄           | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                  |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                  | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| 陸運業 (3.5%)       |         |             |         |             |
| 東武鉄道             | 13      | 13.1        | 41,199  |             |
| 相鉄ホールディングス       | 4.1     | 4.1         | 10,869  |             |
| 東急               | 31.4    | 31.7        | 48,659  |             |
| 京浜急行電鉄           | 16      | 16.7        | 30,561  |             |
| 小田急電鉄            | 18.5    | 20.2        | 64,135  |             |
| 京王電鉄             | 6.4     | 6.9         | 52,854  |             |
| 京成電鉄             | 8.6     | 9.2         | 34,086  |             |
| 富士急行             | 1.8     | 1.9         | 11,837  |             |
| 東日本旅客鉄道          | 21.7    | 22          | 185,724 |             |
| 西日本旅客鉄道          | 11      | 11.1        | 74,747  |             |
| 東海旅客鉄道           | 10.3    | 10.4        | 186,836 |             |
| 西武ホールディングス       | 16.2    | 17.1        | 22,503  |             |
| 西日本鉄道            | 3       | 2.9         | 9,309   |             |
| 近鉄グループホールディングス   | 11.7    | 11.8        | 53,926  |             |
| 阪急阪神ホールディングス     | 15.7    | 15.8        | 59,724  |             |
| 南海電気鉄道           | 5       | 5.2         | 14,341  |             |
| 京阪ホールディングス       | 5.2     | 5.2         | 26,572  |             |
| 名古屋鉄道            | 9.6     | 10          | 27,910  |             |
| 日本通運             | 4.5     | 4.1         | 34,891  |             |
| ヤマトホールディングス      | 20.4    | 16.8        | 50,484  |             |
| 山九               | 3.2     | 3.2         | 16,480  |             |
| 丸運               | 15.6    | 12.5        | 3,862   |             |
| センコーグループホールディングス | 7.4     | 7.8         | 8,494   |             |
| トナミホールディングス      | 3.7     | 0.6         | 3,450   |             |
| ニッコンホールディングス     | 4.2     | 4.2         | 9,714   |             |
| 日本石油輸送           | 1       | 0.6         | 1,679   |             |
| 福山通運             | 1.5     | 1.4         | 6,580   |             |
| セイノーホールディングス     | 8.6     | 9           | 14,319  |             |
| 日立物流             | 2.5     | 2.3         | 8,544   |             |
| C&Fロジホールディングス    | 4       | 1.4         | 2,681   |             |
| 九州旅客鉄道           | 10.4    | 10          | 28,640  |             |
| S G ホールディングス     | 12.2    | 22.6        | 57,381  |             |
| 海運業 (0.3%)       |         |             |         |             |
| 日本郵船             | 9.8     | 10.2        | 41,463  |             |
| 商船三井             | 6.8     | 6.9         | 29,635  |             |
| 川崎汽船             | 1.5     | 4.5         | 12,357  |             |
| 飯野海運             | 8.2     | 15.2        | 9,150   |             |

| 銘<br>柄                    | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|---------------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                           |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                           | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| 空運業 (0.5%)                |         |             |         |             |
| 日本航空                      | 21.2    | 28          | 76,860  |             |
| A N A ホールディングス            | 21.4    | 32.1        | 90,056  |             |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%)           |         |             |         |             |
| 三菱倉庫                      | 3.8     | 3.7         | 12,987  |             |
| 三井倉庫ホールディングス              | 2.3     | 2.2         | 4,941   |             |
| 住友倉庫                      | 4.4     | 4.4         | 6,925   |             |
| 東陽倉庫                      | 15.4    | 13.8        | 5,106   |             |
| 安田倉庫                      | 5.8     | 4.9         | 4,998   |             |
| 上組                        | 7.1     | 6.8         | 14,987  |             |
| キムラユニティー                  | 3.9     | 3.5         | 4,326   |             |
| キユーソー流通システム               | 1.8     | 1.8         | 3,099   |             |
| 近鉄エクスプレス                  | 3.5     | 2.8         | 7,767   |             |
| エーアイティー                   | 4.7     | 4.4         | 4,452   |             |
| 情報・通信業 (9.1%)             |         |             |         |             |
| N E C ネッツエスアイ             | 2.5     | 3.8         | 7,486   |             |
| システナ                      | 4.6     | 4.7         | 10,213  |             |
| デジタルアーツ                   | 0.6     | 0.8         | 8,504   |             |
| 日鉄ソリューションズ                | 1.6     | 1.5         | 5,385   |             |
| T I S                     | 4       | 12.4        | 31,644  |             |
| J N S ホールディングス            | 0.6     | 3.9         | 2,476   |             |
| 電算システム                    | 0.9     | 1.1         | 3,602   |             |
| グリー                       | 9.1     | 9.8         | 5,762   |             |
| ヨーエーテクモホールディングス           | 2.9     | 2.7         | 18,576  |             |
| ブレインパッド                   | 0.2     | 0.7         | 3,801   |             |
| K L a b                   | 3.1     | 4.6         | 3,845   |             |
| ネクソン                      | 34.3    | 30.8        | 107,646 |             |
| エイチーム                     | 0.9     | 5.9         | 10,360  |             |
| コロプラ                      | 4.4     | 6.7         | 5,889   |             |
| サイバーリンクス                  | 2.8     | 0.5         | 896     |             |
| C A R T A H O L D I N G S | 0.3     | 3.8         | 6,118   |             |
| S H I F T                 | —       | 0.4         | 5,100   |             |
| ティーガイア                    | 2.2     | 2           | 4,080   |             |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント      | 3       | 3.6         | 8,121   |             |
| G M O ベイメントゲートウェイ         | 1.8     | 2.6         | 37,206  |             |
| ザッパラス                     | 7.9     | 6.8         | 3,053   |             |
| インターネットイニシアティブ            | 2.2     | 3.8         | 9,321   |             |
| L I N E                   | 3.5     | —           | —       |             |

| 銘<br>柄                 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|------------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                        |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                        | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| チエンジ                   | —       | 1.5         | 4,965   |             |
| フェイス                   | 3       | 3           | 2,499   |             |
| 野村総合研究所                | 17.3    | 22.5        | 76,612  |             |
| C E ホールディングス           | 3.8     | 6.8         | 3,882   |             |
| インデージホールディングス          | 6.4     | 4.5         | 6,093   |             |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 2.8     | 2.3         | 4,866   |             |
| S a n s a n            | —       | 0.7         | 6,888   |             |
| フジ・メディア・ホールディングス       | 12.8    | 12.7        | 18,872  |             |
| オービック                  | 4.2     | 3.9         | 76,713  |             |
| ジャストシステム               | 2       | 1.8         | 10,926  |             |
| Z ホールディングス             | 167.9   | 167.8       | 95,041  |             |
| トレンドマイクロ               | 5.3     | 6.5         | 36,140  |             |
| 日本オラクル                 | 2.3     | 2.4         | 26,112  |             |
| フューチャー                 | 6.4     | 3.7         | 7,895   |             |
| C A C H o l d i n g s  | 3.6     | 5.9         | 8,678   |             |
| S Bテクノロジー              | 2       | 1.7         | 5,584   |             |
| オービックビジネスコンサルタント       | 1.1     | 0.9         | 5,472   |             |
| 伊藤忠テクノソリューションズ         | 5.3     | 5.3         | 18,868  |             |
| 大塚商会                   | 6.5     | 6.5         | 32,825  |             |
| サイボウズ                  | 0.9     | 1.7         | 4,204   |             |
| 電通国際情報サービス             | 2.4     | 1.5         | 6,292   |             |
| デジタルガレージ               | 2.2     | 2           | 8,560   |             |
| ウェザーニューズ               | 1.3     | 0.6         | 3,396   |             |
| 日本エンタープライズ             | 0.1     | 3.7         | 1,010   |             |
| ネットワンシステムズ             | 4.2     | 4.6         | 16,836  |             |
| アルゴグラフィックス             | 2.5     | 1.4         | 4,571   |             |
| エイベックス                 | 4       | 4.2         | 6,791   |             |
| 日本ユニシス                 | 3.7     | 3.6         | 12,600  |             |
| 兼松エレクトロニクス             | 1.4     | 1.6         | 6,120   |             |
| T B S ホールディングス         | 7.8     | 7.9         | 18,794  |             |
| 日本テレビホールディングス          | 11.3    | 11.1        | 17,582  |             |
| テレビ朝日ホールディングス          | 3.2     | 3.2         | 7,468   |             |
| スカパー J S A T ホールディングス  | 12.2    | 13.5        | 6,939   |             |
| テレビ東京ホールディングス          | 2.9     | 2.3         | 5,809   |             |
| 日本電信電話                 | 162     | 142.9       | 421,126 |             |
| K D D I                | 90.4    | 98.2        | 342,619 |             |
| ソフトバンク                 | 110.4   | 111.3       | 165,336 |             |
| 光通信                    | 1.2     | 1.4         | 30,982  |             |

| 銘<br>柄               | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|----------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                      |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                      | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| N T T ドコモ            | 89.5    | —           | —       |             |
| G M O インターネット        | 4.6     | 4.6         | 15,502  |             |
| K A D O K A W A      | 3.5     | 3.5         | 14,542  |             |
| ゼンリン                 | 2.7     | 3.2         | 4,614   |             |
| 松竹                   | 0.6     | 0.8         | 11,152  |             |
| 東宝                   | 7.2     | 7.3         | 31,426  |             |
| 東映                   | 0.4     | 0.2         | 4,778   |             |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 32.3    | 32.7        | 56,080  |             |
| ビジネスプレイン太田昭和         | 1.3     | 2.4         | 4,404   |             |
| D T S                | 3       | 2.9         | 7,780   |             |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 5.2     | 5.2         | 34,008  |             |
| カプコン                 | 5.2     | 5.2         | 36,244  |             |
| S C S K              | 3.2     | 3           | 19,770  |             |
| アイネス                 | 6.1     | 3.1         | 4,284   |             |
| T K C                | 1.9     | 0.8         | 5,544   |             |
| 富士ソフト                | 1.9     | 1.6         | 9,248   |             |
| N S D                | 4       | 4.1         | 8,142   |             |
| コナミホールディングス          | 5       | 4.5         | 30,330  |             |
| ソフトバンクグループ           | 96.1    | 96.8        | 954,835 |             |
| 卸売業(4.9%)            |         |             |         |             |
| 伊藤忠食品                | 0.9     | 0.6         | 3,534   |             |
| エレマテック               | 4.8     | 4.8         | 5,145   |             |
| J A L U X            | 2       | 2           | 3,624   |             |
| 双日                   | 69      | 68.8        | 22,497  |             |
| アルフレッサ ホールディングス      | 13.4    | 13.9        | 30,580  |             |
| 横浜冷凍                 | 8.9     | 5.8         | 5,498   |             |
| 神戸物産                 | 4.1     | 8.2         | 24,386  |             |
| あい ホールディングス          | 3       | 2.6         | 5,774   |             |
| ダイワボウホールディングス        | 1       | 0.8         | 7,672   |             |
| マクニカ・富士エレホールディングス    | 3.7     | 3.2         | 7,171   |             |
| バイタルケースケー・ホールディングス   | 3.7     | 6.9         | 5,602   |             |
| レスターホールディングス         | 2.4     | 2.2         | 4,690   |             |
| O C H I ホールディングス     | 3.1     | 3.1         | 4,519   |             |
| T O K A I ホールディングス   | 6.7     | 7           | 6,776   |             |
| シップヘルスケアホールディングス     | 2.5     | 2.1         | 13,482  |             |
| 明治電機工業               | 2.8     | 2.8         | 4,373   |             |
| コメダホールディングス          | 2.7     | 2.9         | 6,203   |             |
| エコートレーディング           | 7.4     | 7.4         | 5,106   |             |

| 銘<br>柄          | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|-----------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                 |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                 | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| ナガイレーベン         | 1.8     | 2.8         | 7,991   |             |
| 三菱食品            | 2.1     | 2           | 6,460   |             |
| 松田産業            | 4.5     | 2.1         | 4,445   |             |
| 第一興商            | 1.8     | 1.5         | 6,705   |             |
| メディパルホールディングス   | 13.1    | 13.3        | 30,523  |             |
| アズワン            | 0.7     | 0.7         | 9,548   |             |
| 尾家産業            | 3.2     | 3.2         | 4,662   |             |
| ドウシシャ           | 3.2     | 2.9         | 5,573   |             |
| 丸文              | 5.2     | 5.1         | 2,830   |             |
| 橋本総業ホールディングス    | 2.7     | 2.3         | 6,318   |             |
| 日本ライフライン        | 3.1     | 3.4         | 5,174   |             |
| 進和              | 3.5     | 1.9         | 4,142   |             |
| オーハシテクニカ        | 3.1     | 2.3         | 3,781   |             |
| 白銅              | 2.4     | 2.4         | 3,892   |             |
| 伊藤忠商事           | 84.9    | 85.9        | 306,920 |             |
| 丸紅              | 127.2   | 121.1       | 115,262 |             |
| 長瀬産業            | 7       | 7.2         | 13,197  |             |
| 豊田通商            | 13.5    | 12.5        | 59,437  |             |
| 兼松              | 5.3     | 5.2         | 8,195   |             |
| 三井物産            | 107.2   | 100.1       | 238,688 |             |
| 日本紙パルプ商事        | 1.1     | 0.8         | 3,072   |             |
| 日立ハイテク          | 4.2     | —           | —       |             |
| 山善              | 5       | 4.9         | 5,537   |             |
| 住友商事            | 77.1    | 77.8        | 127,086 |             |
| 内田洋行            | 1       | 0.7         | 3,563   |             |
| 三菱商事            | 85.3    | 74.9        | 245,447 |             |
| キヤノンマーケティングジャパン | 2.9     | 2.9         | 7,644   |             |
| 西華産業            | 3.9     | 3.5         | 5,491   |             |
| 菱洋エレクトロ         | 3.2     | 1.8         | 4,771   |             |
| 東京産業            | 2.4     | 4.7         | 3,294   |             |
| 阪和興業            | 1.8     | 3.1         | 10,478  |             |
| 岩谷産業            | 2.6     | 2.6         | 17,186  |             |
| イワキ             | 1.2     | 9.2         | 5,961   |             |
| 三愛石油            | 5.5     | 5.3         | 7,038   |             |
| 稲畑産業            | 3.9     | 3.8         | 6,695   |             |
| ワキタ             | 2.3     | 3.6         | 3,805   |             |
| 東邦ホールディングス      | 3.3     | 3.3         | 6,963   |             |
| サンゲツ            | 3.9     | 3.5         | 6,139   |             |

| 銘<br>柄                          | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |
|---------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|
|                                 |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |
|                                 | 千株      | 千株          | 千円     |             |
| シナネンホールディングス                    | 2.7     | 1.3         | 4,192  |             |
| 伊藤忠エヌクス                         | 5.4     | 5.1         | 5,961  |             |
| サンリオ                            | 3.6     | 3.7         | 6,856  |             |
| リヨーサン                           | 1.9     | 1.7         | 4,093  |             |
| 三信電気                            | 2.3     | 1           | 2,119  |             |
| モスフードサービス                       | 2.2     | 2           | 6,920  |             |
| 加賀電子                            | 2.9     | 2.4         | 6,506  |             |
| 立花エレック                          | 3.3     | 2.5         | 4,112  |             |
| フォーバル                           | 5.2     | 4.6         | 4,126  |             |
| P A L T A C                     | 2       | 1.8         | 10,404 |             |
| 日鉄物産                            | 1.3     | 1.1         | 4,796  |             |
| トラスコ中山                          | 2.6     | 2.5         | 7,600  |             |
| オートバックスセブン                      | 4.8     | 4.8         | 7,521  |             |
| 加藤産業                            | 1.7     | 1.4         | 5,285  |             |
| イノテック                           | 4.6     | 4.3         | 6,136  |             |
| 杉本商事                            | 2.9     | 2.3         | 5,579  |             |
| 因幡電機産業                          | 3.2     | 3.2         | 8,928  |             |
| ミスミグループ本社                       | 15.2    | 15.4        | 50,743 |             |
| スズケン                            | 5.4     | 5.4         | 24,030 |             |
| ジェコス                            | 5.3     | 5.3         | 5,416  |             |
| <b>小売業 (4.7%)</b>               |         |             |        |             |
| ローソン                            | 2.9     | 2.8         | 15,036 |             |
| サンエー                            | 1       | 1.8         | 8,748  |             |
| エービーシー・マート                      | 1.9     | 1.6         | 10,560 |             |
| ハードオフコーポレーション                   | 4.5     | 4.2         | 3,914  |             |
| アスクル                            | 2.3     | 1.8         | 6,642  |             |
| ゲオホールディングス                      | 2.9     | 4.7         | 5,912  |             |
| アダストリア                          | 1.7     | 2.1         | 4,170  |             |
| ジーフット                           | 4.1     | 2.8         | 1,159  |             |
| エディオン                           | 5.3     | 5.2         | 6,635  |             |
| あみやき亭                           | 1.5     | 1           | 3,215  |             |
| ハニーズホールディングス                    | 0.2     | 5.6         | 6,423  |             |
| ジンズホールディングス                     | 0.5     | 0.1         | 785    |             |
| ピックカメラ                          | 6.6     | 6.9         | 9,018  |             |
| D C M ホールディングス                  | 6.4     | 6.6         | 7,570  |             |
| M o n o t a R O                 | 8.6     | 8.8         | 52,624 |             |
| J . F r o n t R i t e i l i n g | 15.6    | 16.4        | 19,384 |             |
| ドトール・日レスホールディングス                | 2.9     | 2.4         | 4,418  |             |

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当期末  |         |     |
|-----------------------------|---------|------|---------|-----|
|                             |         | 株数   | 株数      | 評価額 |
|                             | 千株      | 千株   | 千円      |     |
| マツモトキヨシホールディングス             | 4.9     | 4.9  | 25,186  |     |
| ZOZO                        | 8.7     | 8    | 26,360  |     |
| トレジャー・ファクトリー                | 0.1     | 2.1  | 2,177   |     |
| ココカラファイン                    | 1.1     | 0.9  | 7,974   |     |
| 三越伊勢丹ホールディングス               | 22.9    | 22.9 | 19,671  |     |
| ウエルシアホールディングス               | 3.6     | 7    | 26,635  |     |
| クリエイトＳＤホールディングス             | 2       | 1.8  | 6,678   |     |
| ショッピング                      | 2       | 1.1  | 1,125   |     |
| ジョイフル本田                     | 3.6     | 3.5  | 5,169   |     |
| すかいらーくホールディングス              | 13.7    | 14.4 | 25,070  |     |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス   | 3.6     | 4    | 4,740   |     |
| ゴルフダイジェスト・オンライン             | 5.6     | 4.5  | 5,922   |     |
| あさひ                         | 3.5     | 3.3  | 5,365   |     |
| コスマス薬品                      | 0.5     | 1.1  | 19,063  |     |
| トーエル                        | 3.6     | 2.9  | 2,737   |     |
| セブン＆アイ・ホールディングス             | 47.7    | 48   | 214,224 |     |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス       | 7       | 7.9  | 7,331   |     |
| ツルハホールディングス                 | 2.6     | 2.7  | 39,015  |     |
| サンマルクホールディングス               | 2.3     | 2.8  | 5,247   |     |
| トリドールホールディングス               | 1.8     | 4.5  | 7,992   |     |
| クスリのアオキホールディングス             | 1.1     | 0.9  | 7,677   |     |
| スリーグローバルホールディングス            | 1.1     | 6.7  | 32,394  |     |
| ノジマ                         | —       | 2    | 6,260   |     |
| カッパ・クリエイト                   | 3.6     | 3.9  | 6,493   |     |
| ライトオン                       | 0.2     | 5.2  | 3,723   |     |
| 良品計画                        | 17.5    | 16.3 | 44,873  |     |
| 三城ホールディングス                  | 6.9     | 7.5  | 2,257   |     |
| アドヴァン                       | 3.9     | 3.7  | 4,014   |     |
| G-7ホールディングス                 | 3.1     | 2.3  | 6,338   |     |
| コーナン商事                      | —       | 2.4  | 7,920   |     |
| エコス                         | 2.1     | 1.4  | 2,821   |     |
| マルシェ                        | 4.2     | 3.8  | 1,926   |     |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 27.2    | 24.8 | 62,694  |     |
| 西松屋チェーン                     | 3.9     | 4.1  | 6,227   |     |
| ゼンショーホールディングス               | 5.8     | 5.9  | 17,995  |     |
| サイゼリヤ                       | 3.4     | 3    | 7,377   |     |
| 魚力                          | 2.9     | 2.5  | 4,960   |     |
| ユナイテッドアローズ                  | 1.3     | 2.9  | 5,907   |     |

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末  |         |     |
|-------------------------------|---------|------|---------|-----|
|                               |         | 株数   | 株数      | 評価額 |
|                               | 千株      | 千株   | 千円      |     |
| ハイディ日高                        | 2.3     | 2.2  | 4,180   |     |
| 京都きもの友禅                       | 3.6     | 2.2  | 627     |     |
| コロワイド                         | 3.8     | 3.9  | 8,435   |     |
| 壱番屋                           | 1.2     | 1    | 5,170   |     |
| スギホールディングス                    | 2.5     | 2.4  | 20,808  |     |
| 葉王堂ホールディングス                   | 1.3     | 1.8  | 5,274   |     |
| スクロール                         | 4.4     | 4.6  | 5,271   |     |
| ファミリーマート                      | 9.6     | —    | —       |     |
| 木曽路                           | 2.2     | 2.2  | 5,744   |     |
| 千趣会                           | 15.6    | 14.7 | 5,968   |     |
| ケーヨー                          | 7.8     | 7.8  | 5,928   |     |
| 上新電機                          | 2       | 1.9  | 6,536   |     |
| 日本瓦斯                          | 1.9     | 1.6  | 8,688   |     |
| ロイヤルホールディングス                  | 1.8     | 2.4  | 5,124   |     |
| いなげや                          | 2.6     | 2    | 3,476   |     |
| 島忠                            | 2.4     | —    | —       |     |
| チヨダ                           | 1.9     | 4    | 4,056   |     |
| ライフコーポレーション                   | 1.5     | 1.3  | 4,439   |     |
| AOKIホールディングス                  | 2.5     | 7.5  | 5,220   |     |
| コメリ                           | 1.8     | 2    | 6,320   |     |
| 青山商事                          | 5       | 7    | 6,510   |     |
| しまむら                          | 1.2     | 1.4  | 16,786  |     |
| 高島屋                           | 9.4     | 9.7  | 12,192  |     |
| 松屋                            | 3.5     | 5.1  | 5,293   |     |
| エイチ・ツー・オー リテイリング              | 6.3     | 7    | 7,007   |     |
| 丸井グループ                        | 10.9    | 11.4 | 26,151  |     |
| アクシアル リテイリング                  | 0.7     | 1    | 5,120   |     |
| イオン                           | 46.9    | 47.2 | 153,919 |     |
| イズミ                           | 2.2     | 2.1  | 9,712   |     |
| 平和堂                           | 3.1     | 2.7  | 6,118   |     |
| フジ                            | 2.3     | 2.2  | 4,736   |     |
| ヤオコー                          | 1.2     | 1.1  | 7,634   |     |
| ゼビオホールディングス                   | 4.2     | 4.2  | 4,111   |     |
| ケーズホールディングス                   | 12.1    | 12.8 | 19,980  |     |
| G e n k y D r u g S t o r e s | 1.4     | 1.1  | 4,169   |     |
| ブックオフグループホールディングス             | 1.1     | 2.7  | 2,667   |     |
| AINホールディングス                   | 1.7     | 1.5  | 10,740  |     |
| ヤマダホールディングス                   | 37      | 39.1 | 24,163  |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当期末   |         |                 | 銘柄      | 期首(前期末) | 当期末     |    |     |
|---------------------|---------|-------|---------|-----------------|---------|---------|---------|----|-----|
|                     |         | 株数    | 株数      | 評価額             |         |         | 株数      | 株数 | 評価額 |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |                 |         | 千株      | 千株      | 千円 |     |
| ニトリホールディングス         | 5.3     | 4.9   | 103,659 | ふくおかフィナンシャルグループ | 10.4    | 10.8    | 25,779  |    |     |
| 吉野家ホールディングス         | 4.3     | 4.3   | 9,683   | 静岡銀行            | 30.5    | 29.3    | 26,838  |    |     |
| 王将フードサービス           | 0.9     | 0.7   | 4,158   | 十六銀行            | 2.6     | 2.1     | 5,138   |    |     |
| プレナス                | 3.2     | 2.9   | 5,715   | スルガ銀行           | 12.4    | 13.3    | 6,290   |    |     |
| ミニストップ              | 2.6     | 3.1   | 4,575   | 八十二銀行           | 27.2    | 29.1    | 12,716  |    |     |
| アークス                | 2       | 2.9   | 7,134   | 山梨中央銀行          | 1.9     | 3       | 3,087   |    |     |
| バローホールディングス         | 2.4     | 2.3   | 6,152   | 大垣共立銀行          | 2.6     | 2.5     | 6,022   |    |     |
| ファーストリテイリング         | 1.6     | 1.6   | 139,024 | 福井銀行            | 2.1     | 2.1     | 4,527   |    |     |
| サンドラッグ              | 4.3     | 4.1   | 16,994  | 北國銀行            | 1.9     | 2       | 6,090   |    |     |
| ヤマザワ                | 2.4     | 2.4   | 4,188   | 滋賀銀行            | 2.3     | 3.2     | 8,051   |    |     |
| ベルーナ                | 1.7     | 4.7   | 6,138   | 南都銀行            | 1.6     | 2.5     | 5,402   |    |     |
| 銀行業 (5.7%)          |         |       |         | 百五銀行            | 15.5    | 17.4    | 6,316   |    |     |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 64      | 71.4  | 20,491  | 京都銀行            | 4.2     | 4.2     | 30,450  |    |     |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 2.4     | 3.8   | 5,931   | 紀陽銀行            | 4       | 4       | 7,104   |    |     |
| 九州フィナンシャルグループ       | 19.5    | 24.9  | 13,197  | ほくほくフィナンシャルグループ | 7.6     | 7.8     | 9,118   |    |     |
| ゆうちょ銀行              | 34.4    | 35.4  | 39,895  | 広島銀行            | 17.7    | —       | —       |    |     |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 74      | 74.2  | 36,358  | 山陰合同銀行          | 3.6     | 9.5     | 5,605   |    |     |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 7.3     | 8     | 6,872   | 中国銀行            | 9.6     | 10      | 10,090  |    |     |
| 関西みらいフィナンシャルグループ    | 1.7     | 12.6  | 8,694   | 鳥取銀行            | 0.9     | 1.6     | 1,976   |    |     |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 2.1     | 3.8   | 6,000   | 伊予銀行            | 15.8    | 17      | 12,580  |    |     |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 2       | 2.6   | 7,683   | 百十四銀行           | 2.2     | 2.1     | 3,922   |    |     |
| ひろぎんホールディングス        | —       | 18.7  | 14,081  | 四国銀行            | 5.7     | 5.7     | 5,141   |    |     |
| 新生銀行                | 8.8     | 9     | 17,262  | 阿波銀行            | 1.3     | 2       | 5,356   |    |     |
| あおぞら銀行              | 6.4     | 6.9   | 18,505  | 大分銀行            | 0.6     | 1.9     | 4,531   |    |     |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 832.1   | 840.4 | 549,537 | 宮崎銀行            | 1       | 2       | 5,210   |    |     |
| りそなホールディングス         | 133.8   | 135.9 | 67,121  | 佐賀銀行            | 2.4     | 2.4     | 4,082   |    |     |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 23      | 23.2  | 96,164  | 沖縄銀行            | 1.3     | 2.2     | 7,150   |    |     |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 84.4    | 84.4  | 363,088 | 琉球銀行            | 3.2     | 4.2     | 3,662   |    |     |
| 千葉銀行                | 40.9    | 41    | 32,718  | セブン銀行           | 42.3    | 45.1    | 12,267  |    |     |
| 群馬銀行                | 25.2    | 26.5  | 11,448  | みずほフィナンシャルグループ  | 1,650.7 | 167.1   | 284,320 |    |     |
| 武蔵野銀行               | 2.6     | 4.3   | 8,870   | 山口フィナンシャルグループ   | 15      | 15.7    | 12,842  |    |     |
| 七十七銀行               | 3.5     | 3.6   | 6,152   | 長野銀行            | 0.9     | 1.9     | 2,869   |    |     |
| 青森銀行                | 0.4     | 1.5   | 4,230   | 名古屋銀行           | 1.1     | 3.7     | 12,876  |    |     |
| 秋田銀行                | 1.3     | 2.8   | 4,698   | 北洋銀行            | 17.8    | 18.4    | 6,292   |    |     |
| 山形銀行                | 1.6     | 4.1   | 5,235   | 中京銀行            | 1.8     | 1.8     | 3,398   |    |     |
| 岩手銀行                | 1       | 2     | 5,452   | 愛媛銀行            | 2.8     | 4.8     | 5,380   |    |     |
| 東邦銀行                | 8.4     | 12.3  | 3,370   | トマト銀行           | 1.7     | 2.2     | 2,842   |    |     |
| 東北銀行                | 0.9     | 2.1   | 2,698   | 京葉銀行            | 4       | 7.5     | 3,787   |    |     |

| 銘柄                        | 期首(前期末) | 当期末   |         |     |
|---------------------------|---------|-------|---------|-----|
|                           |         | 株数    | 株数      | 評価額 |
| 栃木銀行                      |         | 千株    | 千株      | 千円  |
| トモニホールディングス               | 14.3    | 19.3  | 4,149   |     |
| フィデアホールディングス              | 13.2    | 13.4  | 4,663   |     |
| 池田泉州ホールディングス              | 17      | 22    | 3,498   |     |
| 証券、商品先物取引業 (0.9%)         | 10.4    | 24    | 4,944   |     |
| F P G                     | 5.7     | 7.4   | 5,416   |     |
| S B I ホールディングス            | 13.7    | 14.2  | 46,718  |     |
| ジャフコ グループ                 | 1.9     | 1.6   | 10,816  |     |
| 大和証券グループ本社                | 98      | 99.1  | 59,014  |     |
| 野村ホールディングス                | 213.4   | 188.3 | 131,979 |     |
| 岡三証券グループ                  | 10.2    | 11.2  | 5,633   |     |
| 丸三証券                      | 5.1     | 7.3   | 5,350   |     |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス      | 11      | 18.2  | 7,953   |     |
| 水戸証券                      | 7.3     | 12.3  | 4,501   |     |
| いちよし証券                    | 4       | 6.9   | 4,616   |     |
| 松井証券                      | 6.1     | 6.8   | 6,398   |     |
| だいこう証券ビジネス                | 6.9     | —     | —       |     |
| マネックスグループ                 | 4.2     | 12.6  | 12,978  |     |
| 極東証券                      | 3.6     | 5.6   | 5,510   |     |
| 藍澤證券                      | 4.9     | 5.8   | 6,461   |     |
| 保険業 (1.9%)                |         |       |         |     |
| かんぽ生命保険                   | 4.7     | 15.5  | 37,215  |     |
| S O M P O ホールディングス        | 23      | 21.8  | 96,116  |     |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 31.8    | 30    | 103,110 |     |
| ソニーフィナンシャルホールディングス        | 9.8     | —     | —       |     |
| 第一生命ホールディングス              | 68.9    | 65.2  | 129,943 |     |
| 東京海上ホールディングス              | 43.6    | 40.9  | 219,183 |     |
| T & D ホールディングス            | 36.7    | 37    | 54,649  |     |
| その他金融業 (1.1%)             |         |       |         |     |
| 全国保証                      | 3.1     | 3.2   | 16,768  |     |
| クレディセゾン                   | 8.1     | 8.5   | 12,478  |     |
| 芙蓉総合リース                   | 1.3     | 1.1   | 8,965   |     |
| みずほリース                    | 2.1     | 1.9   | 6,925   |     |
| 東京センチュリー                  | 2.4     | 2.7   | 19,602  |     |
| 日本証券金融                    | 4.8     | 9.2   | 7,185   |     |
| アイフル                      | 21      | 18.7  | 6,133   |     |
| リコリース                     | 1.4     | 1.3   | 4,907   |     |
| イオンフィナンシャルサービス            | 8       | 8.1   | 12,838  |     |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末  |         |         |
|--------------------|---------|------|---------|---------|
|                    |         | 株数   | 株数      | 評価額     |
| アコム                |         | 千株   | 千株      | 千円      |
| オリエントコーポレーション      | 25.3    | 26.8 | 14,498  |         |
| 日立キャピタル            | 28.9    | 35.1 | 5,826   |         |
| オリックス              | 2.9     | 2.9  | 10,121  |         |
| 三菱UFJリース           | 76.3    | 74.7 | 146,038 |         |
| 日本取引所グループ          | 27.3    | 30.3 | 20,997  |         |
| アサックス              | 35.2    | 33.3 | 84,348  |         |
| N E C キャピタルソリューション | 6.1     | 5.5  | 4,229   |         |
| 不動産業 (2.0%)        | 1.5     | 1.9  | 4,278   |         |
| いちご                |         | 18.1 | 17.5    | 5,932   |
| ヒューリック             |         | 25.9 | 27.5    | 35,832  |
| 野村不動産ホールディングス      |         | 8.1  | 7.8     | 21,114  |
| ユニゾホールディングス        |         | 1.4  | —       | —       |
| オーブンハウス            |         | 3.1  | 3.5     | 16,957  |
| 東急不動産ホールディングス      |         | 31.9 | 34      | 23,086  |
| 飯田グループホールディングス     |         | 9.9  | 10.3    | 28,623  |
| パーク24              |         | 7    | 7.1     | 15,669  |
| 三井不動産              |         | 60.2 | 56.5    | 148,821 |
| 三菱地所               |         | 85   | 80.3    | 156,665 |
| 平和不動産              |         | 2.9  | 2.6     | 9,061   |
| 東京建物               |         | 13.6 | 12.2    | 21,008  |
| ダイビル               |         | 5.2  | 5.1     | 7,094   |
| 京阪神ビルディング          |         | 2.5  | 2.8     | 4,650   |
| 住友不動産              |         | 27.4 | 27.7    | 110,633 |
| テーオーシー             |         | 6.2  | 6.2     | 5,177   |
| スターツコーポレーション       |         | 1.9  | 1.7     | 5,355   |
| 空港施設               |         | 6.1  | 5.5     | 3,311   |
| ゴールドクリスト           |         | 3.4  | 3.4     | 6,011   |
| エスリード              |         | 3.5  | 2       | 3,762   |
| A V A N T I A      |         | 4.6  | 4.3     | 3,844   |
| イオンモール             |         | 6.3  | 6.4     | 12,217  |
| カチタス               |         | 1.7  | 3.3     | 10,032  |
| 日本空港ビルディング         |         | 3.9  | 3.9     | 20,631  |
| サービス業 (5.3%)       |         | —    | 2.3     | 6,835   |
| ミクシィ               |         | 8.8  | 9.8     | 60,074  |
| 日本M&Aセンター          |         | —    | 2       | 7,330   |
| U T グループ           |         | 5.2  | 2.3     | 4,328   |
| パソナグループ            |         |      |         |         |

| 銘<br>柄             | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|--------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                    |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                    | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| G C A              | 7.3     | 7.3         | 6,424   |             |
| エス・エム・エス           | 4.2     | 3.9         | 12,792  |             |
| パーソルホールディングス       | 12      | 12.5        | 27,037  |             |
| クックパッド             | 11.6    | 13.3        | 4,375   |             |
| 学情                 | 0.9     | 2.6         | 4,282   |             |
| スタジオアリス            | 1.7     | 1.7         | 3,598   |             |
| シミックホールディングス       | 1.7     | 3.7         | 6,068   |             |
| N J S              | 2.5     | 2.5         | 5,165   |             |
| 綜合警備保障             | 4.7     | 4.7         | 24,816  |             |
| カカクコム              | 8.7     | 9.1         | 29,120  |             |
| アイロムグループ           | 1.5     | 2           | 5,282   |             |
| ディップ               | 3.9     | 2.4         | 7,464   |             |
| キャリアデザインセンター       | 2.5     | 2.5         | 2,700   |             |
| ベネフィット・ワン          | 3.3     | 3.6         | 10,584  |             |
| エムスリー              | 25.9    | 21          | 154,728 |             |
| アウトソーシング           | 4.4     | 4.5         | 8,217   |             |
| ディー・エヌ・エー          | 6.1     | 5.6         | 12,605  |             |
| 博報堂D Yホールディングス     | 16.4    | 17.3        | 33,216  |             |
| ぐるなび               | 0.2     | 5.3         | 3,529   |             |
| ファンコミュニケーションズ      | 10.5    | 10.5        | 4,494   |             |
| W D B ホールディングス     | 2.3     | 1.5         | 3,934   |             |
| インフォマート            | 12.2    | 12.8        | 12,185  |             |
| E P S ホールディングス     | 2.8     | 4.6         | 5,566   |             |
| クイック               | 1.7     | 3.7         | 4,643   |             |
| ケネディクス             | 11.1    | —           | —       |             |
| 電通グループ             | 12.4    | 13.4        | 52,796  |             |
| H. U. グループホールディングス | 3.1     | 3           | 10,830  |             |
| ダイオーズ              | 3.8     | 3.4         | 3,366   |             |
| 日本空調サービス           | 7.6     | 7.1         | 5,658   |             |
| オリエンタルランド          | 12.4    | 12.7        | 215,455 |             |
| ダスキン               | 3       | 3           | 8,622   |             |
| ラウンドワン             | 3.8     | 5.2         | 6,604   |             |
| リゾートトラスト           | 5       | 5           | 9,720   |             |
| ビー・エム・エル           | 2       | 1.7         | 6,230   |             |
| りらいあコミュニケーションズ     | 5.2     | 4.6         | 6,946   |             |
| リゾー教育              | 4.2     | 13.4        | 4,623   |             |
| 早稲田アカデミー           | 4.6     | 2.6         | 2,438   |             |
| ユー・エス・エス           | 14.8    | 13.6        | 28,587  |             |

| 銘<br>柄                 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |
|------------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                        |         | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 |
|                        | 千株      | 千株          | 千円      |             |
| サイバーエージェント             | 6.7     | 7.3         | 54,677  |             |
| 楽天                     | 55      | 56.2        | 83,176  |             |
| ティー・オー・ダブリュー           | 5.6     | 4.9         | 1,597   |             |
| エン・ジャパン                | 1.4     | 1.4         | 4,452   |             |
| テクノプロ・ホールディングス         | 2.4     | 2.3         | 20,309  |             |
| インターワークス               | 4       | 4.8         | 2,064   |             |
| アイ・アールジャパンホールディングス     | —       | 0.1         | 1,301   |             |
| ジャパンマテリアル              | 3.2     | 3.2         | 4,368   |             |
| キャリアリンク                | 0.1     | 1.5         | 4,042   |             |
| ライドオンエクスプレスホールディングス    | 0.7     | 1.3         | 2,286   |             |
| リクルートホールディングス          | 85.1    | 85.5        | 438,615 |             |
| エラン                    | 1.3     | 2           | 2,838   |             |
| 日本郵政                   | 96.2    | 90.2        | 97,957  |             |
| ペイカレント・コンサルティング        | —       | 0.8         | 19,680  |             |
| M S - J a p a n        | 0.9     | 1.6         | 1,640   |             |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | —       | 2.6         | 6,227   |             |
| リログループ                 | 6.6     | 6.7         | 15,095  |             |
| エイチ・アイ・エス              | 1.8     | 2.3         | 5,529   |             |
| 共立メンテナンス               | 1.5     | 1.4         | 5,439   |             |
| 建設技術研究所                | 6.5     | 2           | 5,206   |             |
| よみうりランド                | 0.9     | —           | —       |             |
| 東京都競馬                  | 1.4     | 1.3         | 7,462   |             |
| カナモト                   | 1.9     | 2.4         | 6,960   |             |
| 東京ドーム                  | 6.4     | —           | —       |             |
| トランス・コスモス              | 3.4     | 1.7         | 5,210   |             |
| 乃村工藝社                  | 5.5     | 5.8         | 5,782   |             |
| 日本管財                   | 3.5     | 3.2         | 7,411   |             |
| 白洋舎                    | 1.4     | 1           | 2,400   |             |
| セコム                    | 12.5    | 11.8        | 110,648 |             |
| セントラル警備保障              | 0.8     | 1.7         | 6,120   |             |
| メイティック                 | 1.4     | 1.2         | 7,416   |             |
| 応用地質                   | 5.1     | 4.7         | 6,363   |             |
| 船井総研ホールディングス           | 2.5     | 2.4         | 5,169   |             |
| ベネッセホールディングス           | 4.2     | 4.2         | 10,239  |             |
| イオンディライト               | 1.5     | 1.9         | 6,498   |             |
| ニチイ学館                  | 4.7     | —           | —       |             |
| ダイセキ                   | 1.8     | 1.8         | 6,570   |             |

| 銘柄   | 期首(前期末) | 当期末    |        |            |
|------|---------|--------|--------|------------|
|      |         | 株数     | 株数     | 評価額        |
| ステップ | 千株      | 千株     | 千円     |            |
|      | 3       | 3      | 4,836  |            |
| 合計   | 株数・金額   | 14,335 | 13,148 | 34,015,253 |
|      | 銘柄数<比率> | 1,083  | 1,078  | <92.3%>    |

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別       | 当期末          |          |
|-----------|--------------|----------|
|           | 買建額          | 売建額      |
| 国内 株式先物取引 | 百万円<br>3,454 | 百万円<br>— |
| TOPIX     |              |          |

### ○投資信託財産の構成

(2021年3月22日現在)

| 項目           | 当期末              |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評価額              | 比率        |
| 株式           | 千円<br>34,015,253 | %<br>91.6 |
| コール・ローン等、その他 | 3,116,229        | 8.4       |
| 投資信託財産総額     | 37,131,482       | 100.0     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月22日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 円               |
| コレ・ローン等         | 37,581,767,425  |
| 株式(評価額)         | 3,084,144,886   |
| 未収入金            | 34,015,253,450  |
| 未収配当金           | 89,417,300      |
| 差入委託証拠金         | 45,773,789      |
| 差入委託証拠金         | 347,178,000     |
| (B) 負債          | 734,663,152     |
| 未払解約金           | 283,861,549     |
| 未払利息            | 1,603           |
| 差入委託証拠金代用有価証券   | 450,800,000     |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 36,847,104,273  |
| 元本              | 21,694,054,482  |
| 次期繰越損益金         | 15,153,049,791  |
| (D) 受益権総口数      | 21,694,054,482口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,985円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は22,566,115,300円、期中追加設定元本額は13,501,009,590円、期中一部解約元本額は14,373,070,408円です。

(元本の内訳)

|  |                 |
|--|-----------------|
| 東京海上セレクション・日本株T O P I X  | 15,365,477,589円 |
| 東京海上・TOP I Xインデックスファンド<適格機関投資家限定>  | 3,171,650,028円  |
| 東京海上・世界インデックス・バランス6.0<適格機関投資家限定>   | 897,016,179円    |
| TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>   | 501,416,690円    |
| 円資産バランスファンド2019-12<適格機関投資家限定>  | 396,825,543円    |
| 円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>  | 364,187,015円    |
| 円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>  | 298,371,304円    |
| 円資産バランスオーブン<適格機関投資家限定>   | 201,198,189円    |
| 東京海上・世界インデックス・バランス4.0<適格機関投資家限定>   | 132,262,969円    |
| 円資産バランスファンド2018-09<適格機関投資家限定>  | 104,988,636円    |
| L P S 4資産分散ファンド(積極型)   | 53,658,435円     |
| L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)   | 50,018,069円     |
| ターゲット・イヤー・ファンド2035   | 42,915,415円     |
| L P S 4資産分散ファンド(バランス型)   | 34,519,517円     |
| ターゲット・イヤー・ファンド2065   | 28,235,559円     |
| ターゲット・イヤー・ファンド2045   | 15,214,438円     |
| ターゲット・イヤー・ファンド2055   | 13,215,591円     |
| L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)   | 10,095,080円     |
| L P S 4資産分散ファンド(慎重型)   | 6,812,998円      |
| 東京海上・円資産インデックスバランスファンド   | 5,975,238円      |
| (注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。 |                 |
| (注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。     |                 |
| (注) 2021年3月22日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。<br>・株式       | 781,510,000円    |

## ○損益の状況 (2020年3月24日~2021年3月22日)

| 項目               | 当期末             |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益        | 円               |
| 受取配当金            | 643,360,185     |
| 受取利息             | 643,956,921     |
| その他収益金           | 12,895          |
| 支払利息             | 136,995         |
| △                | △ 746,626       |
| (B) 有価証券売買損益     | 12,167,682,157  |
| 売買益              | 12,279,329,932  |
| 売買損              | △ 111,647,775   |
| (C) 先物取引等取引損益    | 870,127,400     |
| 取引益              | 969,679,200     |
| 取引損              | △ 99,551,800    |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 13,681,169,742  |
| (E) 前期繰越損益金      | 1,773,472,074   |
| (F) 追加信託差損益金     | 6,143,230,730   |
| (G) 解約差損益金       | △ 6,444,822,755 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 15,153,049,791  |
| 次期繰越損益金(H)       | 15,153,049,791  |

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換算によるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

## TMA日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第16期（決算日 2021年11月10日）

(計算期間 2020年11月11日～2021年11月10日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。  
また、一印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

## ○最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額  | ベ ン チ マ ー ク |         | 債 組 入 比 率 | 純 資 産 額           |
|------------------|----------|-------------|---------|-----------|-------------------|
|                  |          | 期 謄         | 中 率     |           |                   |
| 12期(2017年11月10日) | 円 12,715 | % △0.9      | 380.302 | % △1.0    | % 99.2 百万円 21,910 |
| 13期(2018年11月12日) | 12,710   | △0.0        | 379.669 | △0.2      | 99.5 5,155        |
| 14期(2019年11月11日) | 13,072   | 2.8         | 390.121 | 2.8       | 99.5 12,937       |
| 15期(2020年11月10日) | 12,957   | △0.9        | 386.816 | △0.8      | 99.4 18,955       |
| 16期(2021年11月10日) | 12,975   | 0.1         | 387.538 | 0.2       | 99.7 21,249       |

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日                | 基 準 価 額  | ベ ン チ マ ー ク |         | 債 組 入 比 率 |          |
|----------------------|----------|-------------|---------|-----------|----------|
|                      |          | 騰 落         | 率 %     |           |          |
| (期 首)<br>2020年11月10日 | 円 12,957 | —           | —       | 386.816   | % — 99.4 |
| 11月末                 | 12,968   | 0.1         | 387.118 | 0.1       | 100.2    |
| 12月末                 | 12,968   | 0.1         | 387.203 | 0.1       | 100.3    |
| 2021年1月末             | 12,936   | △0.2        | 386.252 | △0.1      | 100.1    |
| 2月末                  | 12,828   | △1.0        | 383.056 | △1.0      | 100.0    |
| 3月末                  | 12,918   | △0.3        | 385.724 | △0.3      | 100.2    |
| 4月末                  | 12,941   | △0.1        | 386.440 | △0.1      | 100.0    |
| 5月末                  | 12,947   | △0.1        | 386.621 | △0.1      | 100.1    |
| 6月末                  | 12,954   | △0.0        | 386.903 | 0.0       | 100.2    |
| 7月末                  | 13,018   | 0.5         | 388.809 | 0.5       | 100.2    |
| 8月末                  | 13,008   | 0.4         | 388.461 | 0.4       | 100.0    |
| 9月末                  | 12,962   | 0.0         | 387.116 | 0.1       | 100.1    |
| 10月末                 | 12,948   | △0.1        | 386.721 | △0.0      | 100.0    |
| (期 末)<br>2021年11月10日 | 12,975   | 0.1         | 387.538 | 0.2       | 99.7     |

(注) 謄落率は期首比です。

当ファンドのベンチマークはNOMURA-BPI（野村ボンド・パフォーマンス・インデックス）（総合）であり、NOMURA-BPI（総合）とは、野村證券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。

## ○運用経過

(2020年11月11日～2021年11月10日)

### ■期中の基準価額等の推移

期 首：12,957円  
期 末：12,975円  
騰落率： 0.1%

### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・保有する債券の利息収入

#### マイナス要因

- ・「2%の物価目標を実現するためのより効果的で持続的な金融緩和の点検」の内容を巡る日銀の金融政策に対する不透明感などを背景に10年国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

### ■投資環境

10年国債利回りは小幅に上昇しました。

期初、0.04%程度であった10年国債利回りは、「2%の物価目標を実現するためのより効果的で持続的な金融緩和の点検」の内容を巡る日銀の金融政策に対する不透明感などを背景として、2021年2月下旬に0.17%程度の水準まで上昇しました。3月の日銀金融政策決定会合後は、緩和的な金融政策が継続するとの見方が大勢を占めたことから低下基調で推移ましたが、期末にかけて原油高やサプライチェーンの混乱などを背景としたインフレ懸念のほか、主要中央銀行の金融政策正常化に向けた動きが意識されるなか10年国債利回りは上昇し、0.06%程度の水準で期を終えました。

### ■ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動することを目標に、ファンドとベンチマークのリスク特性値が近似するよう調整して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は前期末対比0.1%上昇しました。

### ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、基準価額の騰落率は+0.1%となり、ベンチマークの騰落率+0.2%にほぼ連動する値動きとなりました。

#### (主な差異要因)

#### プラス要因

- ・特にありません

#### マイナス要因

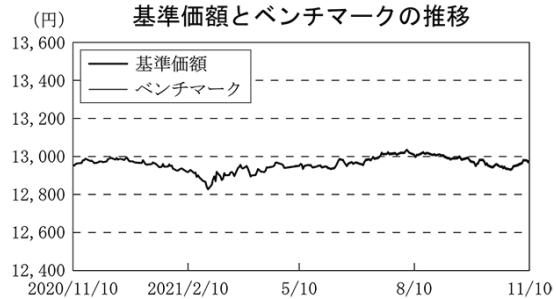
- ・リバランスなどに伴う取引コスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>(\*)</sup>は、10月末現在、推定値で0.04%となりました。

※2021年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

## ○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。



(注) ベンチマークは、期首（2020年11月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年11月11日～2021年11月10日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2020年11月11日～2021年11月10日)

## 公社債

|    |                | 買付額             | 売付額                           |
|----|----------------|-----------------|-------------------------------|
| 国内 | 国債証券           | 千円<br>9,108,171 | 千円<br>6,938,156<br>( 120,000) |
|    | 地方債証券          | 213,377         | —                             |
|    | 特殊債券           | —               | —                             |
|    | 社債券（投資法人債券を含む） | 311,577         | ( 100,000)<br>—<br>( 54,722)  |
|    |                |                 |                               |

(注) 金額は受渡代金です。（経過利子分は含まれていません）

(注) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれていません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年11月11日～2021年11月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2021年11月10日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区分                  | 額面金額                       | 評価額                        | 組入比率           | 当期末        |                |                |                |
|---------------------|----------------------------|----------------------------|----------------|------------|----------------|----------------|----------------|
|                     |                            |                            |                | うちB級以下組入比率 | 残存期間別組入比率      |                |                |
|                     |                            |                            |                |            | 5年以上           | 2年以上           | 2年末満           |
| 国債証券                | 千円<br>17,677,000           | 千円<br>18,520,228           | %<br>87.2      | %<br>—     | %<br>56.7      | %<br>20.1      | %<br>10.3      |
| 地方債証券               | 1,120,000<br>( 1,120,000)  | 1,151,558<br>( 1,151,558)  | 5.4<br>( 5.4)  | —<br>(—)   | 3.0<br>( 3.0)  | 1.4<br>( 1.4)  | 0.9<br>( 0.9)  |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 300,000<br>( 300,000)      | 303,210<br>( 303,210)      | 1.4<br>( 1.4)  | —<br>(—)   | 0.5<br>( 0.5)  | 0.5<br>( 0.5)  | 0.5<br>( 0.5)  |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 1,134,105<br>( 1,134,105)  | 1,202,602<br>( 1,202,602)  | 5.7<br>( 5.7)  | —<br>(—)   | 3.2<br>( 3.2)  | 1.9<br>( 1.9)  | 0.5<br>( 0.5)  |
| 合計                  | 20,231,105<br>( 2,554,105) | 21,177,599<br>( 2,657,370) | 99.7<br>(12.5) | —<br>(—)   | 63.4<br>( 6.8) | 24.0<br>( 3.9) | 12.2<br>( 1.9) |

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄             | 利率    | 当期末     |         |            | 銘柄             | 利率  | 当期末     |         |            |
|----------------|-------|---------|---------|------------|----------------|-----|---------|---------|------------|
|                |       | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |                |     | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| <b>国債証券</b>    | %     | 千円      | 千円      |            | <b>国債証券</b>    | %   | 千円      | 千円      |            |
| 第418回利付国債(2年)  | 0.1   | 28,000  | 28,058  | 2022/11/1  | 第343回利付国債(10年) | 0.1 | 195,000 | 196,848 | 2026/6/20  |
| 第419回利付国債(2年)  | 0.1   | 70,000  | 70,158  | 2022/12/1  | 第344回利付国債(10年) | 0.1 | 215,000 | 217,150 | 2026/9/20  |
| 第420回利付国債(2年)  | 0.1   | 60,000  | 60,150  | 2023/1/1   | 第345回利付国債(10年) | 0.1 | 180,000 | 181,846 | 2026/12/20 |
| 第421回利付国債(2年)  | 0.1   | 85,000  | 85,228  | 2023/2/1   | 第346回利付国債(10年) | 0.1 | 154,000 | 155,657 | 2027/3/20  |
| 第422回利付国債(2年)  | 0.1   | 74,000  | 74,211  | 2023/3/1   | 第347回利付国債(10年) | 0.1 | 270,000 | 273,042 | 2027/6/20  |
| 第423回利付国債(2年)  | 0.005 | 100,000 | 100,173 | 2023/4/1   | 第348回利付国債(10年) | 0.1 | 260,000 | 263,062 | 2027/9/20  |
| 第424回利付国債(2年)  | 0.005 | 120,000 | 120,219 | 2023/5/1   | 第349回利付国債(10年) | 0.1 | 243,000 | 245,984 | 2027/12/20 |
| 第425回利付国債(2年)  | 0.005 | 100,000 | 100,194 | 2023/6/1   | 第350回利付国債(10年) | 0.1 | 200,000 | 202,492 | 2028/3/20  |
| 第426回利付国債(2年)  | 0.005 | 100,000 | 100,204 | 2023/7/1   | 第351回利付国債(10年) | 0.1 | 50,000  | 50,631  | 2028/6/20  |
| 第427回利付国債(2年)  | 0.005 | 140,000 | 140,301 | 2023/8/1   | 第352回利付国債(10年) | 0.1 | 220,000 | 222,807 | 2028/9/20  |
| 第429回利付国債(2年)  | 0.005 | 50,000  | 50,118  | 2023/10/1  | 第353回利付国債(10年) | 0.1 | 242,000 | 245,199 | 2028/12/20 |
| 第134回利付国債(5年)  | 0.1   | 110,000 | 110,255 | 2022/12/20 | 第354回利付国債(10年) | 0.1 | 240,000 | 243,103 | 2029/3/20  |
| 第135回利付国債(5年)  | 0.1   | 310,000 | 310,902 | 2023/3/20  | 第355回利付国債(10年) | 0.1 | 188,000 | 190,370 | 2029/6/20  |
| 第136回利付国債(5年)  | 0.1   | 240,000 | 240,828 | 2023/6/20  | 第356回利付国債(10年) | 0.1 | 242,000 | 244,959 | 2029/9/20  |
| 第137回利付国債(5年)  | 0.1   | 130,000 | 130,531 | 2023/9/20  | 第357回利付国債(10年) | 0.1 | 150,000 | 151,768 | 2029/12/20 |
| 第138回利付国債(5年)  | 0.1   | 258,000 | 259,197 | 2023/12/20 | 第358回利付国債(10年) | 0.1 | 95,000  | 96,074  | 2030/3/20  |
| 第139回利付国債(5年)  | 0.1   | 232,000 | 233,204 | 2024/3/20  | 第359回利付国債(10年) | 0.1 | 294,000 | 297,039 | 2030/6/20  |
| 第140回利付国債(5年)  | 0.1   | 220,000 | 221,234 | 2024/6/20  | 第360回利付国債(10年) | 0.1 | 195,000 | 196,813 | 2030/9/20  |
| 第141回利付国債(5年)  | 0.1   | 235,000 | 236,480 | 2024/9/20  | 第361回利付国債(10年) | 0.1 | 71,000  | 71,580  | 2030/12/20 |
| 第142回利付国債(5年)  | 0.1   | 210,000 | 211,440 | 2024/12/20 | 第362回利付国債(10年) | 0.1 | 150,000 | 151,048 | 2031/3/20  |
| 第143回利付国債(5年)  | 0.1   | 211,000 | 212,561 | 2025/3/20  | 第363回利付国債(10年) | 0.1 | 182,000 | 183,044 | 2031/6/20  |
| 第144回利付国債(5年)  | 0.1   | 185,000 | 186,439 | 2025/6/20  | 第364回利付国債(10年) | 0.1 | 60,000  | 60,264  | 2031/9/20  |
| 第145回利付国債(5年)  | 0.1   | 130,000 | 131,082 | 2025/9/20  | 第1回利付国債(30年)   | 2.8 | 5,000   | 6,121   | 2029/9/20  |
| 第146回利付国債(5年)  | 0.1   | 116,000 | 117,004 | 2025/12/20 | 第2回利付国債(30年)   | 2.4 | 24,000  | 28,862  | 2030/2/20  |
| 第147回利付国債(5年)  | 0.005 | 190,000 | 190,913 | 2026/3/20  | 第3回利付国債(30年)   | 2.3 | 20,000  | 23,970  | 2030/5/20  |
| 第148回利付国債(5年)  | 0.005 | 213,000 | 214,033 | 2026/6/20  | 第5回利付国債(30年)   | 2.2 | 40,000  | 48,240  | 2031/5/20  |
| 第149回利付国債(5年)  | 0.005 | 20,000  | 20,097  | 2026/9/20  | 第18回利付国債(30年)  | 2.3 | 4,000   | 5,105   | 2035/3/20  |
| 第5回利付国債(40年)   | 2.0   | 30,000  | 40,941  | 2052/3/20  | 第22回利付国債(30年)  | 2.5 | 5,000   | 6,590   | 2036/3/20  |
| 第6回利付国債(40年)   | 1.9   | 18,000  | 24,238  | 2053/3/20  | 第26回利付国債(30年)  | 2.4 | 11,000  | 14,496  | 2037/3/20  |
| 第7回利付国債(40年)   | 1.7   | 40,000  | 51,850  | 2054/3/20  | 第27回利付国債(30年)  | 2.5 | 8,000   | 10,720  | 2037/9/20  |
| 第8回利付国債(40年)   | 1.4   | 36,000  | 43,700  | 2055/3/20  | 第28回利付国債(30年)  | 2.5 | 20,000  | 26,921  | 2038/3/20  |
| 第9回利付国債(40年)   | 0.4   | 79,000  | 72,136  | 2056/3/20  | 第29回利付国債(30年)  | 2.4 | 50,000  | 66,794  | 2038/9/20  |
| 第10回利付国債(40年)  | 0.9   | 59,000  | 62,968  | 2057/3/20  | 第31回利付国債(30年)  | 2.2 | 44,000  | 57,777  | 2039/9/20  |
| 第11回利付国債(40年)  | 0.8   | 70,000  | 72,447  | 2058/3/20  | 第32回利付国債(30年)  | 2.3 | 10,000  | 13,351  | 2040/3/20  |
| 第12回利付国債(40年)  | 0.5   | 68,000  | 63,689  | 2059/3/20  | 第33回利付国債(30年)  | 2.0 | 38,000  | 48,832  | 2040/9/20  |
| 第13回利付国債(40年)  | 0.5   | 104,000 | 97,123  | 2060/3/20  | 第34回利付国債(30年)  | 2.2 | 53,000  | 70,262  | 2041/3/20  |
| 第14回利付国債(40年)  | 0.7   | 56,000  | 55,913  | 2061/3/20  | 第35回利付国債(30年)  | 2.0 | 40,000  | 51,726  | 2041/9/20  |
| 第325回利付国債(10年) | 0.8   | 8,000   | 8,062   | 2022/9/20  | 第36回利付国債(30年)  | 2.0 | 50,000  | 64,873  | 2042/3/20  |
| 第326回利付国債(10年) | 0.7   | 10,000  | 10,089  | 2022/12/20 | 第37回利付国債(30年)  | 1.9 | 43,000  | 55,151  | 2042/9/20  |
| 第327回利付国債(10年) | 0.8   | 170,000 | 171,713 | 2022/12/20 | 第38回利付国債(30年)  | 1.8 | 43,000  | 54,468  | 2043/3/20  |
| 第328回利付国債(10年) | 0.6   | 23,000  | 23,221  | 2023/3/20  | 第39回利付国債(30年)  | 1.9 | 38,000  | 48,994  | 2043/6/20  |
| 第329回利付国債(10年) | 0.8   | 45,000  | 45,658  | 2023/6/20  | 第40回利付国債(30年)  | 1.8 | 47,000  | 59,685  | 2043/9/20  |
| 第330回利付国債(10年) | 0.8   | 103,000 | 104,754 | 2023/9/20  | 第41回利付国債(30年)  | 1.7 | 73,000  | 91,347  | 2043/12/20 |
| 第331回利付国債(10年) | 0.6   | 55,000  | 55,731  | 2023/9/20  | 第42回利付国債(30年)  | 1.7 | 73,000  | 91,439  | 2044/3/20  |
| 第332回利付国債(10年) | 0.6   | 30,000  | 30,456  | 2023/12/20 | 第43回利付国債(30年)  | 1.7 | 14,000  | 17,554  | 2044/6/20  |
| 第333回利付国債(10年) | 0.6   | 63,000  | 64,062  | 2024/3/20  | 第44回利付国債(30年)  | 1.7 | 21,000  | 26,358  | 2044/9/20  |
| 第334回利付国債(10年) | 0.6   | 30,000  | 30,560  | 2024/6/20  | 第45回利付国債(30年)  | 1.5 | 26,000  | 31,548  | 2044/12/20 |
| 第335回利付国債(10年) | 0.5   | 180,000 | 183,198 | 2024/9/20  | 第46回利付国債(30年)  | 1.5 | 68,000  | 82,564  | 2045/3/20  |
| 第336回利付国債(10年) | 0.5   | 68,000  | 69,303  | 2024/12/20 | 第47回利付国債(30年)  | 1.6 | 51,000  | 63,110  | 2045/6/20  |
| 第337回利付国債(10年) | 0.3   | 10,000  | 10,130  | 2024/12/20 | 第48回利付国債(30年)  | 1.4 | 72,000  | 85,903  | 2045/9/20  |
| 第338回利付国債(10年) | 0.4   | 40,000  | 40,693  | 2025/3/20  | 第49回利付国債(30年)  | 1.4 | 64,000  | 76,391  | 2045/12/20 |
| 第339回利付国債(10年) | 0.4   | 180,000 | 183,355 | 2025/6/20  | 第50回利付国債(30年)  | 0.8 | 57,000  | 60,254  | 2046/3/20  |
| 第340回利付国債(10年) | 0.4   | 70,000  | 71,410  | 2025/9/20  | 第51回利付国債(30年)  | 0.3 | 81,000  | 76,198  | 2046/6/20  |
| 第341回利付国債(10年) | 0.3   | 90,000  | 91,540  | 2025/12/20 | 第52回利付国債(30年)  | 0.5 | 92,000  | 90,597  | 2046/9/20  |
| 第342回利付国債(10年) | 0.1   | 220,000 | 221,971 | 2026/3/20  | 第53回利付国債(30年)  | 0.6 | 68,000  | 68,447  | 2046/12/20 |

| 銘柄             | 利率  | 当期末    |        |            |  | 銘柄             | 利率  | 当期末        |            |            |  |
|----------------|-----|--------|--------|------------|--|----------------|-----|------------|------------|------------|--|
|                |     | 額面金額   | 評価額    | 償還年月日      |  |                |     | 額面金額       | 評価額        | 償還年月日      |  |
| <b>国債証券</b>    | %   | 千円     | 千円     |            |  | <b>国債証券</b>    | %   | 千円         | 千円         |            |  |
| 第54回利付国債(30年)  | 0.8 | 35,000 | 36,823 | 2047/3/20  |  | 第122回利付国債(20年) | 1.8 | 25,000     | 28,998     | 2030/9/20  |  |
| 第55回利付国債(30年)  | 0.8 | 50,000 | 52,569 | 2047/6/20  |  | 第123回利付国債(20年) | 2.1 | 88,000     | 104,733    | 2030/12/20 |  |
| 第56回利付国債(30年)  | 0.8 | 47,000 | 49,324 | 2047/9/20  |  | 第124回利付国債(20年) | 2.0 | 40,000     | 47,242     | 2030/12/20 |  |
| 第57回利付国債(30年)  | 0.8 | 48,000 | 50,337 | 2047/12/20 |  | 第125回利付国債(20年) | 2.2 | 45,000     | 54,158     | 2031/3/20  |  |
| 第58回利付国債(30年)  | 0.8 | 72,000 | 75,362 | 2048/3/20  |  | 第126回利付国債(20年) | 2.0 | 31,000     | 36,730     | 2031/3/20  |  |
| 第59回利付国債(30年)  | 0.7 | 69,000 | 70,421 | 2048/6/20  |  | 第127回利付国債(20年) | 1.9 | 25,000     | 29,387     | 2031/3/20  |  |
| 第60回利付国債(30年)  | 0.9 | 37,000 | 39,521 | 2048/9/20  |  | 第129回利付国債(20年) | 1.8 | 18,000     | 21,041     | 2031/6/20  |  |
| 第61回利付国債(30年)  | 0.7 | 72,000 | 73,251 | 2048/12/20 |  | 第130回利付国債(20年) | 1.8 | 54,000     | 63,269     | 2031/9/20  |  |
| 第62回利付国債(30年)  | 0.5 | 99,000 | 95,550 | 2049/3/20  |  | 第131回利付国債(20年) | 1.7 | 45,000     | 52,283     | 2031/9/20  |  |
| 第63回利付国債(30年)  | 0.4 | 50,000 | 46,854 | 2049/6/20  |  | 第132回利付国債(20年) | 1.7 | 52,000     | 60,536     | 2031/12/20 |  |
| 第64回利付国債(30年)  | 0.4 | 92,000 | 86,066 | 2049/9/20  |  | 第133回利付国債(20年) | 1.8 | 71,000     | 83,368     | 2031/12/20 |  |
| 第65回利付国債(30年)  | 0.4 | 79,000 | 73,779 | 2049/12/20 |  | 第134回利付国債(20年) | 1.8 | 46,000     | 54,152     | 2032/3/20  |  |
| 第66回利付国債(30年)  | 0.4 | 95,000 | 88,676 | 2050/3/20  |  | 第135回利付国債(20年) | 1.7 | 20,000     | 23,338     | 2032/3/20  |  |
| 第67回利付国債(30年)  | 0.6 | 48,000 | 47,193 | 2050/6/20  |  | 第136回利付国債(20年) | 1.6 | 40,000     | 46,266     | 2032/3/20  |  |
| 第68回利付国債(30年)  | 0.6 | 60,000 | 59,055 | 2050/9/20  |  | 第137回利付国債(20年) | 1.7 | 18,000     | 21,055     | 2032/6/20  |  |
| 第69回利付国債(30年)  | 0.7 | 23,000 | 23,253 | 2050/12/20 |  | 第138回利付国債(20年) | 1.5 | 40,000     | 45,948     | 2032/6/20  |  |
| 第70回利付国債(30年)  | 0.7 | 36,000 | 36,353 | 2051/3/20  |  | 第139回利付国債(20年) | 1.6 | 52,000     | 60,279     | 2032/6/20  |  |
| 第71回利付国債(30年)  | 0.7 | 88,000 | 88,871 | 2051/6/20  |  | 第140回利付国債(20年) | 1.7 | 60,000     | 70,348     | 2032/9/20  |  |
| 第72回利付国債(30年)  | 0.7 | 22,000 | 22,191 | 2051/9/20  |  | 第141回利付国債(20年) | 1.7 | 50,000     | 58,755     | 2032/12/20 |  |
| 第53回利付国債(20年)  | 2.1 | 20,000 | 20,047 | 2021/12/20 |  | 第142回利付国債(20年) | 1.8 | 45,000     | 53,374     | 2032/12/20 |  |
| 第60回利付国債(20年)  | 1.4 | 8,000  | 8,133  | 2022/12/20 |  | 第143回利付国債(20年) | 1.6 | 65,000     | 75,817     | 2033/3/20  |  |
| 第62回利付国債(20年)  | 0.8 | 21,000 | 21,307 | 2023/6/20  |  | 第144回利付国債(20年) | 1.5 | 70,000     | 80,864     | 2033/3/20  |  |
| 第63回利付国債(20年)  | 1.8 | 6,000  | 6,184  | 2023/6/20  |  | 第145回利付国債(20年) | 1.7 | 119,000    | 140,440    | 2033/6/20  |  |
| 第66回利付国債(20年)  | 1.8 | 60,000 | 62,426 | 2023/12/20 |  | 第146回利付国債(20年) | 1.7 | 84,000     | 99,341     | 2033/9/20  |  |
| 第67回利付国債(20年)  | 1.9 | 30,000 | 31,422 | 2024/3/20  |  | 第147回利付国債(20年) | 1.6 | 80,000     | 93,848     | 2033/12/20 |  |
| 第70回利付国債(20年)  | 2.4 | 40,000 | 42,628 | 2024/6/20  |  | 第148回利付国債(20年) | 1.5 | 115,000    | 133,748    | 2034/3/20  |  |
| 第71回利付国債(20年)  | 2.2 | 45,000 | 47,722 | 2024/6/20  |  | 第149回利付国債(20年) | 1.5 | 44,000     | 51,253     | 2034/6/20  |  |
| 第74回利付国債(20年)  | 2.1 | 20,000 | 21,381 | 2024/12/20 |  | 第150回利付国債(20年) | 1.4 | 103,000    | 118,865    | 2034/9/20  |  |
| 第75回利付国債(20年)  | 2.1 | 30,000 | 32,236 | 2025/3/20  |  | 第151回利付国債(20年) | 1.2 | 109,000    | 123,235    | 2034/12/20 |  |
| 第76回利付国債(20年)  | 1.9 | 10,000 | 10,678 | 2025/3/20  |  | 第152回利付国債(20年) | 1.2 | 117,000    | 132,389    | 2035/3/20  |  |
| 第78回利付国債(20年)  | 1.9 | 10,000 | 10,727 | 2025/6/20  |  | 第153回利付国債(20年) | 1.3 | 131,000    | 150,085    | 2035/6/20  |  |
| 第79回利付国債(20年)  | 2.0 | 10,000 | 10,763 | 2025/6/20  |  | 第154回利付国債(20年) | 1.2 | 103,000    | 116,730    | 2035/9/20  |  |
| 第80回利付国債(20年)  | 2.1 | 40,000 | 43,199 | 2025/6/20  |  | 第155回利付国債(20年) | 1.0 | 123,000    | 136,126    | 2035/12/20 |  |
| 第81回利付国債(20年)  | 2.0 | 28,000 | 30,288 | 2025/9/20  |  | 第156回利付国債(20年) | 0.4 | 97,000     | 99,153     | 2036/3/20  |  |
| 第82回利付国債(20年)  | 2.1 | 40,000 | 43,424 | 2025/9/20  |  | 第157回利付国債(20年) | 0.2 | 131,000    | 129,984    | 2036/6/20  |  |
| 第83回利付国債(20年)  | 2.1 | 15,000 | 16,367 | 2025/12/20 |  | 第158回利付国債(20年) | 0.5 | 103,000    | 106,535    | 2036/9/20  |  |
| 第84回利付国債(20年)  | 2.0 | 60,000 | 65,222 | 2025/12/20 |  | 第159回利付国債(20年) | 0.6 | 99,000     | 103,741    | 2036/12/20 |  |
| 第85回利付国債(20年)  | 2.1 | 20,000 | 21,928 | 2026/3/20  |  | 第160回利付国債(20年) | 0.7 | 100,000    | 106,260    | 2037/3/20  |  |
| 第86回利付国債(20年)  | 2.3 | 10,000 | 11,051 | 2026/3/20  |  | 第161回利付国債(20年) | 0.6 | 112,000    | 117,270    | 2037/6/20  |  |
| 第87回利付国債(20年)  | 2.2 | 15,000 | 16,512 | 2026/3/20  |  | 第162回利付国債(20年) | 0.6 | 95,000     | 99,389     | 2037/9/20  |  |
| 第88回利付国債(20年)  | 2.3 | 20,000 | 22,226 | 2026/6/20  |  | 第163回利付国債(20年) | 0.6 | 69,000     | 72,125     | 2037/12/20 |  |
| 第89回利付国債(20年)  | 2.2 | 20,000 | 22,133 | 2026/6/20  |  | 第164回利付国債(20年) | 0.5 | 95,000     | 97,657     | 2038/3/20  |  |
| 第90回利付国債(20年)  | 2.2 | 65,000 | 72,296 | 2026/9/20  |  | 第165回利付国債(20年) | 0.5 | 110,000    | 112,943    | 2038/6/20  |  |
| 第93回利付国債(20年)  | 2.0 | 8,000  | 8,904  | 2027/3/20  |  | 第166回利付国債(20年) | 0.7 | 75,000     | 79,368     | 2038/9/20  |  |
| 第94回利付国債(20年)  | 2.1 | 8,000  | 8,947  | 2027/3/20  |  | 第167回利付国債(20年) | 0.5 | 66,000     | 67,597     | 2038/12/20 |  |
| 第95回利付国債(20年)  | 2.3 | 6,000  | 6,811  | 2027/6/20  |  | 第168回利付国債(20年) | 0.4 | 90,000     | 90,513     | 2039/3/20  |  |
| 第99回利付国債(20年)  | 2.1 | 15,000 | 17,022 | 2027/12/20 |  | 第169回利付国債(20年) | 0.3 | 123,000    | 121,375    | 2039/6/20  |  |
| 第100回利付国債(20年) | 2.2 | 20,000 | 22,926 | 2028/3/20  |  | 第170回利付国債(20年) | 0.3 | 76,000     | 74,857     | 2039/9/20  |  |
| 第105回利付国債(20年) | 2.1 | 20,000 | 23,006 | 2028/9/20  |  | 第171回利付国債(20年) | 0.3 | 75,000     | 73,733     | 2039/12/20 |  |
| 第106回利付国債(20年) | 2.2 | 20,000 | 23,144 | 2028/9/20  |  | 第172回利付国債(20年) | 0.4 | 83,000     | 82,928     | 2040/3/20  |  |
| 第108回利付国債(20年) | 1.9 | 25,000 | 28,538 | 2028/12/20 |  | 第173回利付国債(20年) | 0.4 | 127,000    | 126,669    | 2040/6/20  |  |
| 第111回利付国債(20年) | 2.2 | 7,000  | 8,208  | 2029/6/20  |  | 第174回利付国債(20年) | 0.4 | 116,000    | 115,493    | 2040/9/20  |  |
| 第112回利付国債(20年) | 2.1 | 10,000 | 11,650 | 2029/6/20  |  | 第175回利付国債(20年) | 0.5 | 105,000    | 106,296    | 2040/12/20 |  |
| 第113回利付国債(20年) | 2.1 | 5,000  | 5,850  | 2029/9/20  |  | 第176回利付国債(20年) | 0.5 | 104,000    | 105,112    | 2041/3/20  |  |
| 第116回利付国債(20年) | 2.2 | 40,000 | 47,489 | 2030/3/20  |  | 第177回利付国債(20年) | 0.4 | 85,000     | 84,234     | 2041/6/20  |  |
| 第117回利付国債(20年) | 2.1 | 60,000 | 70,731 | 2030/3/20  |  | 第178回利付国債(20年) | 0.5 | 33,000     | 33,300     | 2041/9/20  |  |
| 第121回利付国債(20年) | 1.9 | 30,000 | 35,064 | 2030/9/20  |  | <b>小計</b>      |     | 17,677,000 | 18,520,228 |            |  |

| 銘柄                        |       | 当期末       |           |            |       |
|---------------------------|-------|-----------|-----------|------------|-------|
|                           |       | 利率        | 額面金額      | 評価額        | 償還年月日 |
| <b>地方債証券</b>              |       |           |           |            |       |
| 第781回東京都公募公債              | %     | 千円        | 千円        |            |       |
| 第781回東京都公募公債(5年)          | 0.16  | 100,000   | 100,857   | 2028/6/20  |       |
| 平成30年度第11回北海道公募公債(5年)     | 0.03  | 100,000   | 100,037   | 2023/9/28  |       |
| 第26回神奈川県公募公債(20年)         | 1.477 | 20,000    | 23,027    | 2034/6/20  |       |
| 第6回大阪府公募公債(20年)           | 1.98  | 50,000    | 58,257    | 2030/9/13  |       |
| 平成28年度第2回京都府公募公債(15年)     | 0.21  | 50,000    | 50,467    | 2031/4/22  |       |
| 第4回静岡県公募公債(20年)           | 2.29  | 100,000   | 112,169   | 2027/3/19  |       |
| 平成31年度第1回愛知県公募公債(10年)     | 0.09  | 100,000   | 100,334   | 2029/4/26  |       |
| 平成29年度第7回広島県公募公債          | 0.2   | 100,000   | 101,079   | 2028/3/23  |       |
| 平成25年度第8回埼玉県公募公債          | 0.703 | 100,000   | 101,481   | 2023/12/25 |       |
| 平成27年度第3回福岡県公募公債          | 0.529 | 200,000   | 203,972   | 2025/8/25  |       |
| 平成29年度第1回広島市公募公債(5年)      | 0.01  | 100,000   | 100,003   | 2022/6/24  |       |
| 令和元年度第3回岡山県公募公債(10年)      | 0.05  | 100,000   | 99,875    | 2030/3/27  |       |
| 小計                        |       | 1,120,000 | 1,151,558 |            |       |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>        |       |           |           |            |       |
| 第38回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.145 | 100,000   | 100,883   | 2028/5/31  |       |
| 第42回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.805 | 100,000   | 100,828   | 2022/11/14 |       |
| 第58回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.645 | 100,000   | 101,499   | 2024/3/15  |       |
| 小計                        |       | 300,000   | 303,210   |            |       |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>    |       |           |           |            |       |
| 第503回中部電力株式会社社債           | 0.584 | 100,000   | 101,642   | 2025/3/25  |       |
| 第536回関西電力株式会社社債           | 0.44  | 100,000   | 101,062   | 2030/12/20 |       |

| 銘柄                      |       | 当期末     |            |            |       |
|-------------------------|-------|---------|------------|------------|-------|
|                         |       | 利率      | 額面金額       | 評価額        | 償還年月日 |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>  |       |         |            |            |       |
| 第10回東京電力パワーグリッド株式会社社債   | %     | 千円      | 千円         |            |       |
| 第106回株式会社日本政策投資銀行無担保社債  | 0.45  | 100,000 | 100,359    | 2023/1/25  |       |
| 第33回道路債券                | 0.02  | 100,000 | 100,000    | 2024/6/20  |       |
| 第23回国際協力銀行債券            | 2.91  | 100,000 | 132,270    | 2034/6/20  |       |
| 第101回都市再生債券             | 2.09  | 100,000 | 108,494    | 2025/12/19 |       |
| 第54回賃付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.935 | 100,000 | 106,818    | 2029/11/20 |       |
| 第55回賃付債権担保住宅金融支援機構債券    | 1.47  | 30,417  | 32,045     | 2046/11/10 |       |
| 第56回賃付債権担保住宅金融支援機構債券    | 1.41  | 34,688  | 36,561     | 2046/12/10 |       |
| 第59回賃付債権担保住宅金融支援機構債券    | 1.42  | 33,150  | 34,910     | 2047/1/10  |       |
| 第16回成田国際空港株式会社社債        | 1.44  | 35,850  | 37,858     | 2047/4/10  |       |
| 第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債  | 0.57  | 100,000 | 101,569    | 2024/10/28 |       |
| 第7回株式会社ファーストリティリング無担保社債 | 1.633 | 100,000 | 107,691    | 2026/12/22 |       |
| 小計                      |       |         | 1,134,105  | 1,202,602  |       |
| 合計                      |       |         | 20,231,105 | 21,177,599 |       |

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

## ○投資信託財産の構成

(2021年11月10日現在)

| 項目           | 当期末        |    |       |
|--------------|------------|----|-------|
|              | 評価額        | 比率 |       |
|              | 千円         | %  |       |
| 公社債          | 21,177,599 |    | 99.3  |
| コール・ローン等、その他 | 151,882    |    | 0.7   |
| 投資信託財産総額     | 21,329,481 |    | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年11月10日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 円               |
| コレ・ローン等         | 21,329,481,209  |
| 公社債(評価額)        | 74,850,793      |
| 未収入金            | 21,177,599,107  |
| 未収利息            | 45,033,300      |
| 前払費用            | 30,493,363      |
| 前払費用            | 1,504,646       |
| (B) 負債          | 79,501,353      |
| 未払金             | 63,443,010      |
| 未払解約金           | 16,058,206      |
| 未払利息            | 137             |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 21,249,979,856  |
| 元本              | 16,378,102,849  |
| 次期繰越損益金         | 4,871,877,007   |
| (D) 受益権総口数      | 16,378,102,849口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,975円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は14,629,174,482円、期中追加設定元本額は4,247,026,768円、期中一部解約元本額は2,498,098,401円です。

## &lt;元本の内訳&gt;

|                                 |                |
|---------------------------------|----------------|
| 東京海上セレクション・日本債券インデックス           | 3,333,049,548円 |
| 円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>   | 2,768,234,122円 |
| 円資産バランスファンド2019-12<適格機関投資家限定>   | 2,753,704,264円 |
| 円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>   | 2,004,038,740円 |
| 円資産バランスオーブン<適格機関投資家限定>          | 1,698,744,840円 |
| 東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定> | 1,658,008,689円 |
| 円資産バランスファン2018-09<適格機関投資家限定>    | 798,070,722円   |
| 東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定> | 495,847,195円   |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)        | 232,397,666円   |
| 円資産インデックスバランス<円券会ベーシック>(適格専用)   | 178,050,176円   |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035          | 134,302,213円   |
| TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>      | 97,452,764円    |
| 東京海上・円資産インデックスバランスファンド          | 67,333,618円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065          | 63,747,003円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045          | 58,925,931円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055          | 36,195,358円    |

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産額となります。

## ○損益の状況

(2020年11月11日～2021年11月10日)

| 項目             | 当期            |
|----------------|---------------|
| (A) 配当等収益      | 円             |
| 受取利息           | 123,816,615   |
| 支払利息           | 123,841,679   |
| (B) 有価証券売買損益   | △ 25,064      |
| 売買益            | △ 91,634,344  |
| 売買損            | 19,693,810    |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 111,328,154 |
| (D) 前期繰越損益金    | 32,182,271    |
| (E) 追加信託差損益金   | 4,326,146,231 |
| (F) 解約差損益金     | 1,254,435,809 |
| (G) 計(C+D+E+F) | △ 740,887,304 |
| 次期繰越損益金(G)     | 4,871,877,007 |

(注) (B) 有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (E) 追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (F) 解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

## TMA外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第16期（決算日 2021年11月10日）

(計算期間 2020年11月11日～2021年11月10日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

## ○最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額  | ベンチマーク           |           | 株 式<br>組 入 比 率 | 株 式<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 券<br>組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|----------|------------------|-----------|----------------|----------------|---------------------------|--------------|
|                  |          | 期<br>騰<br>落<br>率 | 中<br>率    |                |                |                           |              |
| 12期(2017年11月10日) | 円 23,462 | % 31.8           | 1,093,435 | % 31.8         | % 89.0         | % 8.2                     | % 2.4 29,547 |
| 13期(2018年11月12日) | 24,465   | 4.3              | 1,147,119 | 4.9            | 92.4           | 5.1                       | 2.3 8,378    |
| 14期(2019年11月11日) | 26,489   | 8.3              | 1,242,639 | 8.3            | 95.6           | 1.7                       | 2.6 14,331   |
| 15期(2020年11月10日) | 28,804   | 8.7              | 1,357,341 | 9.2            | 94.8           | 2.8                       | 2.2 27,743   |
| 16期(2021年11月10日) | 40,956   | 42.2             | 1,931,538 | 42.3           | 95.3           | 2.5                       | 2.2 61,829   |

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値（TTM）を用いて計算しているため、基準日前日のMSCIコクサイ指数（米ドルベース）を基準日のTTMで委託会社が円換算したものを使用しています。

MSCIコクサイ指数（米ドルベース）とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指標の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指標の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、領布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日          | 基<br>準<br>価<br>額 |             | ペ<br>ン<br>チ<br>マ<br>ー<br>ク | 株<br>組<br>入<br>比<br>率 | 株<br>先<br>物<br>比<br>率 | 投<br>資<br>信<br>託<br>組<br>入<br>比 | 券<br>率   |
|----------------------|------------------|-------------|----------------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|----------|
|                      |                  | 騰<br>落<br>率 |                            |                       |                       |                                 |          |
| (期 首)<br>2020年11月10日 | 円<br>28,804      | %<br>—      | 1,357,341                  | %<br>—                | %<br>94.8             | %<br>2.8                        | %<br>2.2 |
| 11月末                 | 29,499           | 2.4         | 1,390,283                  | 2.4                   | 94.7                  | 5.7                             | 2.2      |
| 12月末                 | 30,343           | 5.3         | 1,430,471                  | 5.4                   | 94.8                  | 6.8                             | 2.1      |
| 2021年1月末             | 30,973           | 7.5         | 1,461,431                  | 7.7                   | 98.3                  | 2.3                             | 2.2      |
| 2月末                  | 32,040           | 11.2        | 1,513,956                  | 11.5                  | 98.1                  | 2.4                             | 2.2      |
| 3月末                  | 34,208           | 18.8        | 1,611,610                  | 18.7                  | 98.0                  | 2.8                             | 2.2      |
| 4月末                  | 35,828           | 24.4        | 1,687,948                  | 24.4                  | 95.2                  | 5.1                             | 2.2      |
| 5月末                  | 36,370           | 26.3        | 1,713,776                  | 26.3                  | 94.2                  | 6.2                             | 2.2      |
| 6月末                  | 37,260           | 29.4        | 1,757,208                  | 29.5                  | 96.6                  | 3.6                             | 2.2      |
| 7月末                  | 37,818           | 31.3        | 1,782,622                  | 31.3                  | 94.9                  | 5.4                             | 2.2      |
| 8月末                  | 38,743           | 34.5        | 1,826,694                  | 34.6                  | 94.5                  | 3.2                             | 2.2      |
| 9月末                  | 37,851           | 31.4        | 1,784,540                  | 31.5                  | 97.6                  | 2.7                             | 2.3      |
| 10月末                 | 40,605           | 41.0        | 1,915,338                  | 41.1                  | 97.5                  | 2.5                             | 2.3      |
| (期 末)<br>2021年11月10日 | 40,956           | 42.2        | 1,931,538                  | 42.3                  | 95.3                  | 2.5                             | 2.2      |

(注) 謄落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ○運用経過

(2020年11月11日～2021年11月10日)

### ■期中の基準価額等の推移

期 首：28,804円  
期 末：40,956円  
騰落率： 42.2%

### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・新型コロナウイルスワクチンの治験において有効性が確認されたこと
- ・米国の追加経済対策やインフラ投資計画への期待
- ・良好な2021年7～9月期企業決算

#### マイナス要因

- ・インフレ懸念を背景とした米国債利回りの上昇
- ・中国の大手不動産開発会社の債務超過や米国の債務上限問題に対する懸念

### ■投資環境

外国株式市場は前期末対比で上昇しました。

期初から2021年2月にかけては、新型コロナウイルスワクチンの治験で有効性が確認されたことや、米国における追加経済対策の成立などが相場を下支えし、外国株式市場は上昇基調で推移しました。

3月以降は、インフレ懸念を背景とした米国債利回りの上昇が相場の重石となる局面があったものの、バイデン米政権によるインフラ投資計画の発表やFRB（米連邦準備制度理事会）高官によるインフレは一時的との発言を受けた米国債利回りの低下などが好感され、外国株式市場は上昇基調が継続しました。

9月に入ると、中国の大手不動産開発会社の債務超過や米国の債務上限問題に対する懸念から外国株式市場が下落する局面はありましたが、期末にかけて良好な7～9月期企業決算や経済指標の改善を受けて、再び上昇基調に転じました。



(注) ベンチマークは、期首（2020年11月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）です。

## ■ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標として運用を行いました。

個別銘柄の選択は、最適化法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しました。その結果、保有銘柄数は前期末の1,027銘柄に対して、当期末には1,062銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は42.2%上昇しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、基準価額の騰落率は+42.2%となり、ベンチマークの騰落率+42.3%にほぼ連動しました。

### (主な差異要因)

#### プラス要因

- 特にありません

#### マイナス要因

- 配当課税や売買コストの影響

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>(\*)</sup>は、過去1年で0.17%となりました。

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの收益率とベンチマークの收益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。ファンドとベンチマークで外貨建資産を円換算する際の為替レートが異なる点を考慮して、トラッキングエラーを算出しています。

## ○今後の運用方針

当ファンドの基本方針に基づき、外国株式指数先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2020年11月11日～2021年11月10日)

| 項目                    | 当期   |         | 項目の概要   |
|-----------------------|------|---------|---|
|                       | 金額   | 比率      |   |
| (a) 売買委託手数料           | 円    | %       | (a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>＊売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料                                    |
| (株式)                  | 6    | 0.017   |   |
| (新株予約権証券)             | (5)  | (0.014) |   |
| (投資信託証券)              | (0)  | (0.000) |   |
| (先物・オプション)            | (1)  | (0.003) |   |
| (b) 有価証券取引税           | 6    | 0.018   | (b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>＊有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                                     |
| (株式)                  | (6)  | (0.018) |   |
| (投資信託証券)              | (0)  | (0.000) |   |
| (c) その他の費用            | 16   | 0.045   | (c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>＊保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>＊その他は、信託事務等に要する諸費用 |
| (保管費用)                | (14) | (0.041) |   |
| (その他)                 | (2)  | (0.004) |   |
| 合計                    | 28   | 0.080   |   |
| 期中の平均基準価額は、35,128円です。 |      |         |   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ○売買及び取引の状況

(2020年11月11日～2021年11月10日)

## 株式

|                    |         | 買付                     |                                 | 売付                 |                              |
|--------------------|---------|------------------------|---------------------------------|--------------------|------------------------------|
|                    |         | 株数                     | 金額                              | 株数                 | 金額                           |
| 外<br>国             | アメリカ    | 百株<br>10,935<br>(△ 80) | 千米ドル<br>129,951<br>( 560)       | 百株<br>320<br>( 27) | 千米ドル<br>1,717<br>( 823)      |
|                    | カナダ     | 1,267<br>( 42)         | 千カナダドル<br>7,739<br>( 17)        | 71<br>( 一)         | 千カナダドル<br>157<br>( 22)       |
|                    | ユーロ     |                        |                                 | 千ユーロ               | 千ユーロ                         |
|                    | ドイツ     | 1,093<br>( 12)         | 4,502<br>( 11)                  | 65<br>( 一)         | 169<br>( 41)                 |
|                    | イタリア    | 1,263                  | 784                             | —                  | —                            |
|                    | フランス    | 913<br>( 88)           | 5,135<br>(△ 72)                 | 228<br>( 一)        | 144<br>( 106)                |
|                    | オランダ    | 706<br>( 51)           | 2,979<br>(△ 249)                | —<br>( 一)          | —<br>( 9)                    |
|                    | スペイン    | 1,715<br>( 2,555)      | 1,391<br>( 50)                  | 2,729<br>( 一)      | 106<br>( 25)                 |
|                    | ベルギー    | 60                     | 355                             | —                  | —                            |
|                    | オーストリア  | 17                     | 59                              | 6                  | 23                           |
|                    | ルクセンブルク | 179                    | 134                             | 65                 | 42                           |
|                    | フィンランド  | 403                    | 632                             | —                  | —                            |
|                    | アイルランド  | 57                     | 407                             | —                  | —                            |
|                    | ポルトガル   | 183                    | 155                             | —                  | —                            |
|                    | その他     | —<br>( 82)             | —<br>( 432)                     | —<br>( 82)         | —<br>( 432)                  |
| ス<br>ウェ<br>ー<br>デン | イギリス    | 10,254<br>(△ 56)       | 千英ポンド<br>5,905<br>( 502)        | 536<br>( 一)        | 千英ポンド<br>199<br>( 30)        |
|                    | スイス     | 591<br>( 一)            | 千スイスフラン<br>4,853<br>( 0.00003)  | —<br>( 一)          | 千スイスフラン<br>—<br>( 24)        |
|                    | スウェーデン  | 1,020<br>( 583)        | 千スウェーデンクローナ<br>18,751<br>( 459) | 145<br>( 一)        | 千スウェーデンクローナ<br>447<br>( 459) |
|                    | ノルウェー   | 190                    | 千ノルウェークローネ<br>2,826             | —                  | 千ノルウェークローネ<br>—              |
|                    | デンマーク   | 188<br>( 63)           | 千デンマーククローネ<br>9,215<br>( 一)     | 19                 | 千デンマーククローネ<br>402            |

|        |          | 買付                    |                            | 売付                |                           |
|--------|----------|-----------------------|----------------------------|-------------------|---------------------------|
|        |          | 株数                    | 金額                         | 株数                | 金額                        |
| 外<br>国 | オーストラリア  | 百株<br>3,073<br>( 130) | 千豪ドル<br>5,963<br>( 53)     | 百株<br>955<br>( 一) | 千豪ドル<br>430<br>( 53)      |
|        | ニュージーランド | 645                   | 千ニュージーランドドル<br>464         | —                 | 千ニュージーランドドル<br>—          |
|        | 香港       | 3,603<br>( 42)        | 千香港ドル<br>13,350<br>( 一)    | 267               | 千香港ドル<br>822              |
|        | シンガポール   | 2,024<br>( 831)       | 千シンガポールドル<br>828<br>( 185) | 215<br>( 831)     | 千シンガポールドル<br>91<br>( 185) |
|        | イスラエル    | 150                   | 千イスラエルシェケル<br>660          | —                 | 千イスラエルシェケル<br>—           |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ( )内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

### 新株予約権証券

|        |     | 買付                 |                      | 売付          |                   |
|--------|-----|--------------------|----------------------|-------------|-------------------|
|        |     | 証券数                | 金額                   | 証券数         | 金額                |
| 外<br>国 | スイス | 証券<br>—<br>(5,554) | 千スイスフラン<br>—<br>( 1) | 証券<br>5,554 | 千スイスフラン<br>0.9439 |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ( )内は割当、権利行使および権利行使期間満了による増減分です。

## 投資信託証券

| 銘柄                                    | 買付     |       | 売付     |      |
|---------------------------------------|--------|-------|--------|------|
|                                       | 口数     | 金額    | 口数     | 金額   |
| アメリカ                                  | 千口     | 千米ドル  | 千口     | 千米ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC   | 0.519  | 95    | —      | —    |
| AMERICAN TOWER CORP                   | 1      | 417   | —      | —    |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC             | 0.455  | 90    | —      | —    |
| BOSTON PROPERTIES INC                 | 0.777  | 81    | —      | —    |
| CAMDEN PROPERTY TRUST                 | 0.204  | 27    | —      | —    |
| CROWN CASTLE INTL CORP                | 1      | 289   | —      | —    |
| DIGITAL REALTY TRUST INC              | 1      | 187   | —      | —    |
| DUKE REALTY CORP                      | 0.976  | 40    | —      | —    |
| EQUINIX INC                           | 0.352  | 272   | —      | —    |
| EQUITY RESIDENTIAL                    | 1      | 75    | —      | —    |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC              | 0.187  | 51    | —      | —    |
| EXTRA SPACE STORAGE INC               | 0.295  | 42    | —      | —    |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST             | —      | —     | 0.502  | 43   |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC             | 1      | 50    | —      | —    |
| HOST HOTELS & RESORTS INC             | 5      | 82    | —      | —    |
| INVITATION HOMES INC                  | 5      | 201   | —      | —    |
| IRON MOUNTAIN INC                     | 0.497  | 14    | 2      | 88   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC          | 3      | 77    | —      | —    |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 0.135  | 19    | —      | —    |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC        | —      | —     | 1      | 55   |
| PROLOGIS INC                          | 2      | 319   | —      | —    |
| PUBLIC STORAGE                        | 0.445  | 132   | —      | —    |
| REALTY INCOME CORP                    | 1      | 94    | —      | —    |
| REGENCY CENTERS CORP                  | 0.768  | 37    | —      | —    |
| SBA COMMUNICATIONS CORP               | 0.358  | 116   | —      | —    |
| SIMON PROPERTY GROUP INC              | 1      | 173   | —      | —    |
| SUN COMMUNITIES INC                   | 0.428  | 71    | —      | —    |
| UDR INC                               | 1      | 52    | —      | —    |
| VENTAS INC                            | 1      | 87    | —      | —    |
| VICI PROPERTIES INC                   | 8      | 246   | —      | —    |
| VORNADO REALTY TRUST                  | 1      | 84    | —      | —    |
| WP CAREY INC                          | 0.501  | 37    | —      | —    |
| WELLTOWER INC                         | 1      | 138   | —      | —    |
| WEYERHAEUSER CO                       | 2      | 75    | —      | —    |
| 小計                                    | 51     | 3,785 | 4      | 187  |
| カナダ                                   | 千カナダドル |       | 千カナダドル |      |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 2      | 39    | —      | —    |
| 小計                                    | 2      | 39    | —      | —    |
| ユーロ                                   | 千ユーロ   |       | 千ユーロ   |      |
| フランス                                  |        |       |        |      |
| KLEPIERRE                             | 2      | 53    | (—)    | (—)  |

| 銘柄      | 買付                                     |       | 売付        |           |
|---------|--|-------|-----------|-----------|
|         | 口数                                     | 金額    | 口数        | 金額        |
| 外<br>国  | ユーロ                                    | 千口    | 千ユーロ      | 千ユーロ      |
|         | フランス                                   |       |           |           |
|         | COVIVIO                                | 0.528 | 38        | —         |
|         | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 0.424 | 28        | —         |
|         | 小計                                     | 3     | 120       | (—) (—)   |
|         | ユーロ計                                   | 3     | 120       | (—) (—)   |
|         | イギリス                                   |       | 千英ポンド     | 千英ポンド     |
|         | BRITISH LAND CO PLC                    | 9     | 48        | —         |
|         | SEGRO PLC                              | 1     | 14        | —         |
|         | LAND SECURITIES GROUP PLC              | 5     | 41        | —         |
|         | 小計                                     | 16    | 104       | —         |
| オーストラリア | オーストラリア                                |       | 千豪ドル      | 千豪ドル      |
|         | MIRVAC GROUP                           | 10    | 27        | —         |
|         | GPT GROUP                              | 3     | 13        | —         |
|         | STOCKLAND                              | 4     | 20        | —         |
|         | GOODMAN GROUP                          | 5     | 104       | —         |
|         | SCENTRE GROUP                          | 15    | 44        | —         |
|         | 小計                                     | 39    | 209       | —         |
|         | 香港                                     |       | 千香港ドル     | 千香港ドル     |
|         | LINK REIT                              | 2     | 197       | —         |
|         | 小計                                     | 2     | 197       | —         |
| シンガポール  | シンガポール                                 |       | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル |
|         | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 40    | 83        | —         |
|         | 小計                                     | 40    | 83        | —         |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

(注) ( )内は分割・償還による増減分です。

### 先物取引の種類別取引状況

| 種類別       | 買建            |               | 売建       |          |
|-----------|---------------|---------------|----------|----------|
|           | 新規買付額         | 決済額           | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国 株式先物取引 | 百万円<br>16,709 | 百万円<br>16,385 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○株式売買比率

(2020年11月11日～2021年11月10日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目                  | 当期           |
|---------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額       | 20,126,443千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 41,213,029千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.48         |

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年11月11日～2021年11月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2021年11月10日現在)

## 外国株式

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末 |       |         | 業種等                    |
|------------------------------|---------|-----|-------|---------|------------------------|
|                              |         | 株数  | 株数    | 評価額     |                        |
|                              |         |     |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                        |
| AFLAC INC                    | 30      | 46  | 261   | 29,459  | 保険                     |
| AES CORPORATION              | —       | 78  | 187   | 21,143  | 公益事業                   |
| AT&T INC                     | 405     | 660 | 1,632 | 184,281 | 電気通信サービス               |
| ABBOTT LABORATORIES          | 105     | 164 | 2,077 | 234,480 | ヘルスケア機器・サービス           |
| ABBVIE INC                   | 104     | 164 | 1,905 | 215,039 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABIOMED INC                  | 3       | 5   | 202   | 22,883  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 47      | 74  | 497   | 56,145  | メディア・娯楽                |
| ADOBE INC                    | 28      | 44  | 3,002 | 338,915 | ソフトウェア・サービス            |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 4       | 7   | 184   | 20,850  | 小売                     |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 71      | 115 | 1,727 | 194,928 | 半導体・半導体製造装置            |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 18      | 27  | 433   | 48,932  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 12      | 19  | 626   | 70,662  | 素材                     |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          | 11      | 18  | 204   | 23,084  | ソフトウェア・サービス            |
| ALBEMARLE CORP               | 7       | 13  | 370   | 41,802  | 素材                     |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 14      | —   | —     | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 4       | 7   | 547   | 61,789  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALLEGHANY CORP               | 0.84    | 1   | 86    | 9,763   | 保険                     |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 19      | 23  | 129   | 14,613  | 公益事業                   |
| ALLSTATE CORP                | 13      | 21  | 250   | 28,249  | 保険                     |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 9       | 14  | 266   | 30,056  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                        | 業<br>種<br>等 |  |
|------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|------------------------|-------------|--|
|                              |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                        |             |  |
|                              |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円                     |             |  |
| ALPHABET INC-CL C            |         | 17          | 26     | 8,047       | 908,238                | メディア・娯楽     |  |
| ALPHABET INC-CL A            |         | 17          | 27     | 8,220       | 927,743                | メディア・娯楽     |  |
| ALTRIA GROUP INC             | 105     | 167         | 750    | 84,661      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| AMAZON.COM INC               | 24      | 41          | 14,952 | 1,687,507   | 小売                     |             |  |
| AMEREN CORPORATION           | 14      | 21          | 181    | 20,505      | 公益事業                   |             |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 26      | 38          | 317    | 35,828      | 公益事業                   |             |  |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY     | 38      | 64          | 1,167  | 131,720     | 各種金融                   |             |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 7       | 10          | 150    | 17,008      | 保険                     |             |  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 51      | 84          | 499    | 56,335      | 保険                     |             |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 10      | 18          | 307    | 34,648      | 公益事業                   |             |  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 11      | 18          | 228    | 25,776      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 7       | 9           | 299    | 33,755      | 各種金融                   |             |  |
| AMETEK INC                   | 10      | 15          | 216    | 24,473      | 資本財                    |             |  |
| AMGEN INC                    | 34      | 52          | 1,108  | 125,130     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 15      | 45          | 374    | 42,247      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| ANALOG DEVICES               | 21      | 49          | 910    | 102,725     | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| ANSYS INC                    | 5       | 9           | 403    | 45,497      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| ANTHEM INC                   | 14      | 22          | 965    | 108,931     | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 16      | 26          | 200    | 22,635      | 各種金融                   |             |  |
| APPLE INC                    | 1,016   | 1,530       | 23,085 | 2,605,434   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| APPLIED MATERIALS INC        | 53      | 84          | 1,325  | 149,595     | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| ARAMARK                      | 23      | 40          | 157    | 17,751      | 消費者サービス                |             |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 28      | 46          | 301    | 34,030      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| ARISTA NETWORKS INC          | 3       | 6           | 335    | 37,840      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| ASSURANT INC                 | 5       | 6           | 104    | 11,841      | 保険                     |             |  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 8       | 12          | 113    | 12,792      | 公益事業                   |             |  |
| AUTODESK INC                 | 13      | 22          | 741    | 83,683      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| AUTOLIV INC                  | 6       | 10          | 103    | 11,721      | 自動車・自動車部品              |             |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 24      | 37          | 860    | 97,158      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| AUTOZONE INC                 | 1       | 2           | 378    | 42,759      | 小売                     |             |  |
| AVANTOR INC                  | —       | 67          | 262    | 29,570      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| avery Dennison CORP          | 5       | 8           | 181    | 20,507      | 素材                     |             |  |
| BAKER HUGHES COMPANY         | 48      | 89          | 225    | 25,395      | エネルギー                  |             |  |
| BALL CORP                    | 19      | 30          | 275    | 31,142      | 素材                     |             |  |
| BANK OF AMERICA CORP         | 452     | 714         | 3,347  | 377,821     | 銀行                     |             |  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 43      | 74          | 434    | 49,016      | 各種金融                   |             |  |
| BAXTER INTL INC              | 28      | 44          | 342    | 38,663      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| BECTON DICKINSON & CO        | 17      | 26          | 653    | 73,726      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| WR BERKLEY CORP              | 10      | 12          | 100    | 11,316      | 保険                     |             |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 79      | 119         | 3,410  | 384,868     | 各種金融                   |             |  |
| BEST BUY COMPANY INC         | 14      | 24          | 319    | 36,023      | 小売                     |             |  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | —       | 2           | 186    | 21,068      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 15      | 25          | 207    | 23,388      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| BIOGEN INC                   | 9       | 15          | 409    | 46,261      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| BIO-TECHNE CORP              | —       | 4           | 245    | 27,655      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| BLACK KNIGHT INC             | —       | 22          | 173    | 19,558      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| BLACKROCK INC                | 8       | 13          | 1,286  | 145,221     | 各種金融                   |             |  |
| BLACKSTONE INC               | 39      | 66          | 969    | 109,455     | 各種金融                   |             |  |

| 銘<br>柄                         | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                       | 業<br>種<br>等 |  |
|--------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|-----------------------|-------------|--|
|                                |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                       |             |  |
|                                |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                |             |  |
| (アメリカ)                         |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円                    |             |  |
| BOEING CO                      | 32      | 54          | 1,198  | 135,306     | 資本財                   |             |  |
| BOOKING HOLDINGS INC           | 2       | 4           | 1,075  | 121,343     | 消費者サービス               |             |  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS   | —       | 18          | 158    | 17,840      | 商業・専門サービス             |             |  |
| BORGWARNER INC                 | 19      | 26          | 124    | 14,090      | 自動車・自動車部品             |             |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP         | 83      | 134         | 575    | 64,992      | ヘルスケア機器・サービス          |             |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO        | 135     | 213         | 1,267  | 143,104     | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 8       | 10          | 189    | 21,377      | ソフトウェア・サービス           |             |  |
| BROADCOM INC                   | 24      | 37          | 2,083  | 235,193     | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| BROWN & BROWN INC              | —       | 35          | 220    | 24,889      | 保険                    |             |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B      | 18      | 26          | 195    | 22,067      | 食品・飲料・タバコ             |             |  |
| BURLINGTON STORES INC          | —       | 8           | 261    | 29,551      | 小売                    |             |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC        | 8       | 12          | 165    | 18,719      | 各種金融                  |             |  |
| CBRE GROUP INC - A             | 22      | 33          | 357    | 40,371      | 不動産                   |             |  |
| CDK GLOBAL INC                 | 11      | —           | —      | —           | ソフトウェア・サービス           |             |  |
| CDW CORP/DE                    | 9       | 13          | 243    | 27,439      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |             |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC     | 17      | 23          | 147    | 16,631      | 素材                    |             |  |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 9       | 10          | 97     | 11,011      | 運輸                    |             |  |
| CIGNA CORP                     | 22      | 31          | 683    | 77,105      | ヘルスケア機器・サービス          |             |  |
| CME GROUP INC                  | 20      | 33          | 741    | 83,706      | 各種金融                  |             |  |
| CMS ENERGY CORP                | 16      | 24          | 147    | 16,636      | 公益事業                  |             |  |
| CSX CORP                       | 40      | 191         | 679    | 76,635      | 運輸                    |             |  |
| CVS HEALTH CORPORATION         | 75      | 116         | 1,082  | 122,182     | ヘルスケア機器・サービス          |             |  |
| CABOT OIL & GAS CORP           | 24      | —           | —      | —           | エネルギー                 |             |  |
| CADENCE DESIGN SYS INC         | 18      | 29          | 542    | 61,211      | ソフトウェア・サービス           |             |  |
| CAMPBELL SOUP CO               | 13      | 21          | 88     | 10,002      | 食品・飲料・タバコ             |             |  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP     | 28      | 45          | 702    | 79,231      | 各種金融                  |             |  |
| CARDINAL HEALTH INC            | 21      | 33          | 165    | 18,624      | ヘルスケア機器・サービス          |             |  |
| CARMAX INC                     | 12      | 20          | 314    | 35,442      | 小売                    |             |  |
| CARLYLE GROUP INC/THE          | —       | 25          | 148    | 16,773      | 各種金融                  |             |  |
| CARRIER GLOBAL CORP            | 53      | 79          | 434    | 48,998      | 資本財                   |             |  |
| CATALENT INC                   | —       | 21          | 263    | 29,776      | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| CATERPILLAR INC                | 31      | 51          | 1,078  | 121,758     | 資本財                   |             |  |
| CELANESE CORP-SERIES A         | 8       | 10          | 181    | 20,470      | 素材                    |             |  |
| CENTENE CORP                   | 36      | 59          | 448    | 50,622      | ヘルスケア機器・サービス          |             |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC         | 38      | 65          | 173    | 19,628      | 公益事業                  |             |  |
| CERNER CORP                    | 14      | 17          | 129    | 14,588      | ヘルスケア機器・サービス          |             |  |
| CHARLES RIVER LABORATORIES     | —       | 6           | 241    | 27,307      | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A   | 9       | 11          | 830    | 93,673      | メディア・娯楽               |             |  |
| CHEVRONTEXACO CORP             | 110     | 171         | 1,991  | 224,733     | エネルギー                 |             |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A    | 1       | 3           | 544    | 61,448      | 消費者サービス               |             |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC         | 16      | 24          | 224    | 25,287      | 家庭用品・パーソナル用品          |             |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP      | 10      | 15          | 189    | 21,425      | 保険                    |             |  |
| CISCO SYSTEMS INC              | 237     | 373         | 2,143  | 241,940     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |             |  |
| CINTAS CORP                    | 5       | 7           | 333    | 37,676      | 商業・専門サービス             |             |  |
| CITIGROUP INC                  | 119     | 190         | 1,294  | 146,085     | 銀行                    |             |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP       | 34      | 42          | 203    | 22,947      | 銀行                    |             |  |
| CITRIX SYSTEMS INC             | 8       | 15          | 138    | 15,662      | ソフトウェア・サービス           |             |  |
| CLOROX COMPANY                 | 8       | 14          | 246    | 27,808      | 家庭用品・パーソナル用品          |             |  |

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                        | 業<br>種<br>等 |  |
|------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|------------------------|-------------|--|
|                              |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                        |             |  |
|                              |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円                     |             |  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | —       | 18          | 368    | 41,564      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| COCA-COLA COMPANY            | 233     | 362         | 2,045  | 230,829     | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| COGNEX CORP                  | 11      | 19          | 163    | 18,441      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 31      | 46          | 373    | 42,169      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 43      | 64          | 499    | 56,428      | 家庭用品・パーソナル用品           |             |  |
| COMCAST CORP-CL A            | 265     | 419         | 2,253  | 254,356     | メディア・娯楽                |             |  |
| COMERICA INC                 | 15      | —           | —      | —           | 銀行                     |             |  |
| CONAGRA BRANDS INC           | 29      | 49          | 162    | 18,292      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| CONCHO RESOURCES INC         | 14      | —           | —      | —           | エネルギー                  |             |  |
| CONOCOPHILLIPS               | 60      | 130         | 987    | 111,480     | エネルギー                  |             |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 18      | 29          | 229    | 25,956      | 公益事業                   |             |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 9       | 15          | 337    | 38,046      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| COOPER COS INC/THE           | 3       | 4           | 180    | 20,407      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| COPART INC                   | 12      | 21          | 339    | 38,318      | 商業・専門サービス              |             |  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 8       | 10          | 126    | 14,293      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| CORNING INC                  | 43      | 71          | 275    | 31,040      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| CORTEVA INC                  | 43      | 65          | 312    | 35,280      | 素材                     |             |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 25      | 39          | 2,031  | 229,307     | 食品・生活必需品小売             |             |  |
| COSTAR GROUP INC             | 2       | 40          | 335    | 37,901      | 商業・専門サービス              |             |  |
| COUPA SOFTWARE INC           | 5       | 9           | 234    | 26,494      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A   | 10      | 19          | 583    | 65,812      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| CROWN HOLDINGS INC           | —       | 13          | 139    | 15,740      | 素材                     |             |  |
| CUMMINS INC                  | 7       | 11          | 271    | 30,656      | 資本財                    |             |  |
| DR HORTON INC                | 22      | 33          | 326    | 36,881      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| DTE ENERGY COMPANY           | 10      | 17          | 196    | 22,155      | 公益事業                   |             |  |
| DANAHER CORP                 | 38      | 60          | 1,818  | 205,199     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 11      | 17          | 264    | 29,890      | 消費者サービス                |             |  |
| DAVITA INC                   | 6       | 9           | 97     | 11,054      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| DEERE & CO                   | 17      | 28          | 1,010  | 114,004     | 資本財                    |             |  |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | —       | 28          | 158    | 17,860      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 18      | 24          | 139    | 15,729      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| DEVON ENERGY CORPORATION     | —       | 70          | 307    | 34,752      | エネルギー                  |             |  |
| DEXCOM INC                   | 6       | 10          | 647    | 73,047      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| THE WALT DISNEY CO           | 107     | 170         | 2,991  | 337,590     | メディア・娯楽                |             |  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 23      | 32          | 375    | 42,383      | 各種金融                   |             |  |
| DISCOVERY INC-A              | 14      | 41          | 109    | 12,379      | メディア・娯楽                |             |  |
| DISCOVERY INC-C              | 30      | 30          | 77     | 8,732       | メディア・娯楽                |             |  |
| DISH NETWORK CORPORATION     | 20      | 26          | 95     | 10,820      | メディア・娯楽                |             |  |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 3       | 3           | 108    | 12,268      | 保険                     |             |  |
| DOCUSIGN INC                 | 11      | 20          | 562    | 63,508      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| Dollar General Corp          | 15      | 22          | 491    | 55,513      | 小売                     |             |  |
| DOLLAR TREE INC              | 14      | 25          | 285    | 32,201      | 小売                     |             |  |
| DOMINION ENERGY INC          | 48      | 73          | 545    | 61,613      | 公益事業                   |             |  |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 2       | 4           | 213    | 24,135      | 消費者サービス                |             |  |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 45      | —           | —      | —           | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| DOVER CORP                   | 9       | 12          | 213    | 24,050      | 資本財                    |             |  |
| DOW INC                      | 45      | 69          | 407    | 45,974      | 素材                     |             |  |
| DUKE ENERGY CORP             | 41      | 64          | 656    | 74,048      | 公益事業                   |             |  |

| 銘<br>柄                                 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |         | 業<br>種<br>等        |  |
|--|---------|-------------|--------|-------------|---------|--------------------|--|
|  |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |         |                    |  |
|  |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |                    |  |
| (アメリカ)                                 |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円      |                    |  |
| DUPONT DE NEMOURS INC                  |         | 45          | 53     | 432         | 48,810  | 素材                 |  |
| DYNATRACE INC                          |         | —           | 26     | 199         | 22,536  | ソフトウェア・サービス        |  |
| EOG RESOURCES INC                      |         | 33          | 60     | 586         | 66,153  | エネルギー              |  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD             |         | 4           | 6      | 97          | 11,055  | 保険                 |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                 |         | —           | 34     | 142         | 16,124  | 保険                 |  |
| EAST WEST BANCORP INC                  |         | 8           | —      | —           | —       | 銀行                 |  |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY               |         | 10          | 14     | 159         | 17,978  | 素材                 |  |
| EBAY INC                               |         | 43          | 63     | 473         | 53,388  | 小売                 |  |
| ECOLAB INC                             |         | 13          | 20     | 471         | 53,198  | 素材                 |  |
| BUNGE LIMITED                          |         | 12          | 16     | 150         | 16,993  | 食品・飲料・タバコ          |  |
| EDISON INTERNATIONAL                   |         | 22          | 39     | 256         | 28,966  | 公益事業               |  |
| Edwards Lifesciences Corp              |         | 36          | 58     | 704         | 79,484  | ヘルスケア機器・サービス       |  |
| ELECTRONIC ARTS INC                    |         | 17          | 26     | 375         | 42,376  | メディア・娯楽            |  |
| EMERSON ELECTRIC CO                    |         | 30          | 48     | 476         | 53,753  | 資本財                |  |
| ENPHASE ENERGY INC                     |         | —           | 12     | 287         | 32,421  | 半導体・半導体製造装置        |  |
| ENTERGY CORP                           |         | 12          | 21     | 219         | 24,758  | 公益事業               |  |
| EPAM SYSTEMS INC                       |         | 4           | 6      | 451         | 50,904  | ソフトウェア・サービス        |  |
| EQUIFAX INC                            |         | 7           | 12     | 363         | 40,970  | 商業・専門サービス          |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC                 |         | 35          | 54     | 189         | 21,382  | 各種金融               |  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC                |         | 19          | 33     | 159         | 17,997  | 公益事業               |  |
| ETSY INC                               |         | —           | 14     | 377         | 42,651  | 小売                 |  |
| EVERGY INC                             |         | 18          | 27     | 178         | 20,103  | 公益事業               |  |
| EVERSOURCE ENERGY                      |         | 19          | 32     | 273         | 30,881  | 公益事業               |  |
| EXELON CORP                            |         | 51          | 75     | 408         | 46,089  | 公益事業               |  |
| EXPEDIA GROUP INC                      |         | 10          | 17     | 328         | 37,067  | 消費者サービス            |  |
| EXPEDITORS INTL WASH INC               |         | 10          | 12     | 154         | 17,463  | 運輸                 |  |
| EXXON MOBIL CORPORATION                |         | 236         | 389    | 2,581       | 291,382 | エネルギー              |  |
| FLIR SYSTEMS INC                       |         | 9           | —      | —           | —       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| FMC CORP                               |         | —           | 13     | 139         | 15,697  | 素材                 |  |
| META PLATFORMS INC-A                   |         | 142         | 221    | 7,444       | 840,153 | メディア・娯楽            |  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC           |         | 2           | 2      | 126         | 14,237  | 各種金融               |  |
| FAIR ISAAC CORP                        |         | —           | 4      | 166         | 18,773  | ソフトウェア・サービス        |  |
| FASTENAL CO                            |         | 31          | 39     | 235         | 26,533  | 資本財                |  |
| FEDEX CORP                             |         | 15          | 23     | 586         | 66,223  | 運輸                 |  |
| F5 NETWORKS INC                        |         | 4           | 6      | 135         | 15,299  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES |         | 37          | 62     | 725         | 81,879  | ソフトウェア・サービス        |  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL            |         | 17          | 26     | 134         | 15,215  | 保険                 |  |
| FIFTH THIRD BANCORP                    |         | 50          | 74     | 326         | 36,872  | 銀行                 |  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA                 |         | 9           | 14     | 323         | 36,460  | 銀行                 |  |
| FISERV INC                             |         | 34          | 61     | 614         | 69,347  | ソフトウェア・サービス        |  |
| FIRSTENERGY CORP                       |         | 42          | 56     | 217         | 24,569  | 公益事業               |  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC              |         | 4           | 7      | 190         | 21,541  | ソフトウェア・サービス        |  |
| FORD MOTOR CO                          |         | 231         | 383    | 771         | 87,044  | 自動車・自動車部品          |  |
| FORTINET INC                           |         | 9           | 15     | 523         | 59,092  | ソフトウェア・サービス        |  |
| FORTIVE CORP                           |         | 17          | 26     | 209         | 23,658  | 資本財                |  |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI           |         | 11          | 16     | 167         | 18,915  | 資本財                |  |
| FOX CORP-CLASS A                       |         | 26          | 32     | 132         | 14,933  | メディア・娯楽            |  |
| FOX CORP-CLASS B                       |         | 15          | 31     | 120         | 13,572  | メディア・娯楽            |  |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                        | 業<br>種<br>等 |  |
|-------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|------------------------|-------------|--|
|                               |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                        |             |  |
|                               |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (アメリカ)                        |         | 百株          | 百株     | 千米 ドル       | 千円                     |             |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 17      | 36          | 129    | 14,670      | 各種金融                   |             |  |
| FREEPORT-MCMORAN INC          | 105     | 153         | 600    | 67,777      | 素材                     |             |  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 11      | 18          | 300    | 33,951      | 保険                     |             |  |
| GARTNER INC                   | 7       | 9           | 330    | 37,302      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| GENERAC HOLDINGS INC          | —       | 7           | 321    | 36,333      | 資本財                    |             |  |
| GENERAL DYNAMICS CORP         | 12      | 20          | 417    | 47,076      | 資本財                    |             |  |
| GENERAL ELECTRIC CO           | 523     | —           | —      | —           | 資本財                    |             |  |
| GENERAL ELECTRIC CO           | —       | 104         | 1,166  | 131,605     | 資本財                    |             |  |
| GENERAL MILS INC              | 34      | 51          | 322    | 36,381      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| GENERAL MOTORS CO             | 76      | 122         | 715    | 80,766      | 自動車・自動車部品              |             |  |
| GENUINE PARTS CO              | 10      | 15          | 207    | 23,431      | 小売                     |             |  |
| GILEAD SCIENCES INC           | 74      | 113         | 751    | 84,869      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| GLOBAL PAYMENTS INC           | 18      | 31          | 421    | 47,608      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| GLOBE LIFE INC                | 6       | 8           | 76     | 8,608       | 保険                     |             |  |
| GODADDY INC - CLASS A         | 14      | 25          | 184    | 20,872      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC       | 18      | 30          | 1,235  | 139,485     | 各種金融                   |             |  |
| WW GRAINGER INC               | 2       | 3           | 154    | 17,412      | 資本財                    |             |  |
| HCA HEALTHCARE INC            | 16      | 24          | 607    | 68,615      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC        | 12      | —           | —      | —           | 資本財                    |             |  |
| HP INC                        | 83      | 119         | 379    | 42,815      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| HALLIBURTON CO                | 60      | 81          | 205    | 23,201      | エネルギー                  |             |  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP   | 22      | 32          | 232    | 26,284      | 保険                     |             |  |
| HASBRO INC                    | 9       | 15          | 149    | 16,882      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| HEICO CORP                    | —       | 12          | 166    | 18,826      | 資本財                    |             |  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 5       | 6           | 107    | 12,079      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| HERSHEY CO/THE                | 7       | 11          | 195    | 22,110      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| HESS CORP                     | 20      | 33          | 287    | 32,404      | エネルギー                  |             |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    | 82      | 148         | 230    | 25,964      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  | 18      | 30          | 454    | 51,270      | 消費者サービス                |             |  |
| HOME DEPOT INC                | 62      | 97          | 3,596  | 405,849     | 小売                     |             |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC   | 39      | 61          | 1,395  | 157,513     | 資本財                    |             |  |
| HORMEL FOODS CORP             | 19      | 28          | 121    | 13,721      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| HOWMET AEROSPACE INC          | —       | 51          | 171    | 19,315      | 資本財                    |             |  |
| HUMANA INC                    | 8       | 11          | 508    | 57,338      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC   | 5       | 8           | 169    | 19,086      | 運輸                     |             |  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     | 91      | 172         | 273    | 30,842      | 銀行                     |             |  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE  | 2       | 3           | 68     | 7,692       | 資本財                    |             |  |
| IAC/INTERACTIVECORP           | 7       | —           | —      | —           | メディア・娯楽                |             |  |
| IAC/INTERACTIVECORP           | —       | 12          | 171    | 19,325      | メディア・娯楽                |             |  |
| IDEX CORP                     | 5       | 7           | 181    | 20,496      | 資本財                    |             |  |
| IDEXX LABORATORIES INC        | 5       | 8           | 508    | 57,382      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC       | 16      | 25          | 603    | 68,083      | 資本財                    |             |  |
| ILLUMINA INC                  | 9       | 14          | 578    | 65,234      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| INCYTE CORP                   | 13      | 27          | 180    | 20,415      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| INGERSOLL-RAND INC            | 24      | 50          | 301    | 34,066      | 資本財                    |             |  |
| INGREDION INC                 | 5       | —           | —      | —           | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| INTEL CORP                    | 246     | 370         | 1,895  | 213,969     | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 31      | 48          | 660    | 74,585      | 各種金融                   |             |  |

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                        | 業<br>種<br>等 |  |
|------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|------------------------|-------------|--|
|                              |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                        |             |  |
|                              |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円                     |             |  |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 50      | 81          | 986    | 111,308     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 5       | 24          | 378    | 42,718      | 素材                     |             |  |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 21      | 32          | 161    | 18,186      | 素材                     |             |  |
| INTERPUBLIC GROUP COS INC    | 37      | 52          | 190    | 21,478      | メディア・娯楽                |             |  |
| INTUIT INC                   | 15      | 26          | 1,608  | 181,540     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 7       | 34          | 1,253  | 141,500     | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 12      | 18          | 471    | 53,170      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 175     | 276         | 4,644  | 524,138     | 銀行                     |             |  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 8       | 15          | 223    | 25,263      | 商業・専門サービス              |             |  |
| JOHNSON & JOHNSON            | 153     | 236         | 3,851  | 434,660     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 19      | 27          | 86     | 9,751       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| KLA CORPORATION              | 9       | 15          | 627    | 70,847      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| KKR & CO INC                 | —       | 55          | 440    | 49,737      | 各種金融                   |             |  |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 6       | 10          | 324    | 36,655      | 運輸                     |             |  |
| KELLOGG CO                   | 13      | 26          | 164    | 18,511      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 32      | 86          | 308    | 34,784      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| KEYCORP                      | 77      | 88          | 209    | 23,593      | 銀行                     |             |  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    | 11      | 16          | 312    | 35,281      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 19      | 26          | 350    | 39,571      | 家庭用品・パーソナル用品           |             |  |
| KINDER MORGAN INC            | 101     | 165         | 278    | 31,441      | エネルギー                  |             |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 10      | 18          | 112    | 12,712      | 運輸                     |             |  |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 37      | 64          | 242    | 27,340      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| KROGER CO                    | 45      | 70          | 295    | 33,329      | 食品・生活必需品小売り            |             |  |
| KYNDRYL HOLDINGS INC-W/I     | —       | 16          | 33     | 3,836       | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| LKQ CORP                     | 23      | 34          | 199    | 22,552      | 小売                     |             |  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 12      | 19          | 446    | 50,419      | 資本財                    |             |  |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 6       | 8           | 234    | 26,467      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| LAM RESEARCH CORP            | 9       | 13          | 820    | 92,578      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| LAMB WESTON HOLDING INC      | 11      | 22          | 134    | 15,231      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 23      | 50          | 206    | 23,311      | 消費者サービス                |             |  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 13      | 21          | 751    | 84,764      | 家庭用品・パーソナル用品           |             |  |
| LEAR CORP                    | 4       | 7           | 131    | 14,883      | 自動車・自動車部品              |             |  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 10      | 15          | 142    | 16,116      | 商業・専門サービス              |             |  |
| LENNAR CORP-CL A             | 19      | 29          | 316    | 35,710      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 2       | 3           | 93     | 10,516      | 資本財                    |             |  |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 8       | 18          | 309    | 34,971      | メディア・娯楽                |             |  |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 18      | 26          | 144    | 16,314      | メディア・娯楽                |             |  |
| ELI LILLY & CO               | 52      | 76          | 1,995  | 225,246     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 17      | 25          | 185    | 20,936      | 保険                     |             |  |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 14      | 20          | 700    | 79,079      | 資本財                    |             |  |
| LOEWS CORP                   | 17      | 27          | 160    | 18,129      | 保険                     |             |  |
| LOWE'S COMPANIES             | 45      | 66          | 1,564  | 176,557     | 小売                     |             |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 7       | 12          | 576    | 65,118      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| M & T BANK CORP              | 6       | 8           | 137    | 15,564      | 銀行                     |             |  |
| MSCI INC                     | 5       | 7           | 515    | 58,205      | 各種金融                   |             |  |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 42      | 63          | 426    | 48,147      | エネルギー                  |             |  |
| MARKEL CORP                  | —       | 1           | 143    | 16,193      | 保険                     |             |  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 2       | 4           | 165    | 18,659      | 各種金融                   |             |  |

| 銘<br>柄                           | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                        | 業<br>種<br>等 |  |
|----------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|------------------------|-------------|--|
|                                  |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                        |             |  |
|                                  |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (アメリカ)                           |         | 百株          | 百株     | 千米 ドル       | 千円                     |             |  |
| MARSH & MCLENNAN COS             | 28      | 44          | 739    | 83,497      | 保険                     |             |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A      | 20      | 30          | 495    | 55,917      | 消費者サービス                |             |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS        | 4       | 6           | 256    | 29,002      | 素材                     |             |  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC           | —       | 85          | 626    | 70,729      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| MASCO CORP                       | 17      | 20          | 135    | 15,257      | 資本財                    |             |  |
| MASIMO CORP                      | 4       | 6           | 195    | 22,086      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| MASTERCARD INC-CLASS A           | 52      | 82          | 2,829  | 319,307     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| MATCH GROUP INC                  | 16      | 28          | 435    | 49,202      | メディア・娯楽                |             |  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS        | 15      | —           | —      | —           | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS      | 7       | 24          | 195    | 22,089      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| MCDONALD'S CORP                  | 44      | 71          | 1,798  | 203,020     | 消費者サービス                |             |  |
| MCKESSON CORP                    | 9       | 14          | 317    | 35,790      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| MERCADOLIBRE INC                 | 2       | 4           | 784    | 88,581      | 小売                     |             |  |
| MERCK & CO. INC.                 | 148     | 232         | 1,921  | 216,832     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| METLIFE INC                      | 40      | 62          | 394    | 44,467      | 保険                     |             |  |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | 1       | 2           | 316    | 35,683      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| MICROSOFT CORP                   | 423     | 658         | 22,114 | 2,495,889   | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC         | 16      | 56          | 466    | 52,612      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| MICRON TECHNOLOGY INC            | 66      | 108         | 823    | 92,946      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| MODERNA INC                      | 19      | 33          | 791    | 89,307      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| MOHAWK INDUSTRIES INC            | 4       | 6           | 107    | 12,101      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| MOLINA HEALTHCARE INC            | —       | 6           | 195    | 22,023      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B  | 12      | 27          | 125    | 14,129      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC       | 78      | 116         | 726    | 82,002      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC     | —       | 5           | 297    | 33,605      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP            | 21      | 29          | 275    | 31,057      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| MOODY'S CORP                     | 10      | 14          | 560    | 63,313      | 各種金融                   |             |  |
| MORGAN STANLEY                   | 83      | 128         | 1,282  | 144,717     | 各種金融                   |             |  |
| MOSAIC CO/THE                    | 41      | 43          | 163    | 18,491      | 素材                     |             |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC           | 9       | 14          | 353    | 39,889      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| NRG ENERGY INC                   | 16      | 29          | 101    | 11,466      | 公益事業                   |             |  |
| NVR INC                          | 0.26    | 0.37        | 192    | 21,715      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| NASDAQ INC                       | 8       | 10          | 213    | 24,053      | 各種金融                   |             |  |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC       | 33      | —           | —      | —           | エネルギー                  |             |  |
| NETAPP INC                       | 12      | 22          | 208    | 23,508      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| NETFLIX INC                      | 26      | 41          | 2,695  | 304,209     | メディア・娯楽                |             |  |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC       | 7       | 15          | 144    | 16,293      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD       | —       | 26          | 154    | 17,403      | 資本財                    |             |  |
| NEWELL BRANDS INC                | 31      | 39          | 97     | 10,985      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| NEWMONT CORPORATION              | 52      | 67          | 385    | 43,488      | 素材                     |             |  |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I           | 38      | 61          | 146    | 16,577      | メディア・娯楽                |             |  |
| NEXTERA ENERGY INC               | 116     | 180         | 1,536  | 173,455     | 公益事業                   |             |  |
| NIKE INC -CL B                   | 73      | 115         | 2,014  | 227,384     | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| NISOURCE INC                     | 32      | 45          | 113    | 12,853      | 公益事業                   |             |  |
| NORDSON CORP                     | 4       | 5           | 132    | 14,897      | 資本財                    |             |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP            | 14      | 22          | 635    | 71,691      | 運輸                     |             |  |
| NORTHERN TRUST CORP              | 13      | 20          | 247    | 27,939      | 各種金融                   |             |  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP            | 8       | 12          | 469    | 52,987      | 資本財                    |             |  |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                        | 業<br>種<br>等 |  |
|-------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|------------------------|-------------|--|
|                               |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                        |             |  |
|                               |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (アメリカ)                        |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円                     |             |  |
| NORTONLIFELOCK INC            | 39      | 60          | 152    | 17,218      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| NUCOR CORP                    | 23      | 29          | 339    | 38,292      | 素材                     |             |  |
| NVIDIA CORP                   | 36      | 231         | 7,094  | 800,666     | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| OGE ENERGY CORP               | 17      | —           | —      | —           | 公益事業                   |             |  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC       | 4       | 6           | 394    | 44,515      | 小売                     |             |  |
| OKTA INC                      | 8       | 14          | 384    | 43,388      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE INC | 6       | 8           | 297    | 33,603      | 運輸                     |             |  |
| OMNICOM GROUP                 | —       | 21          | 148    | 16,724      | メディア・娯楽                |             |  |
| ONEOK INC                     | 29      | 46          | 298    | 33,668      | エネルギー                  |             |  |
| ORACLE CORPORATION            | 119     | 172         | 1,626  | 183,617     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP           | 22      | 34          | 289    | 32,622      | 資本財                    |             |  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP  | 22      | 36          | 765    | 86,432      | 銀行                     |             |  |
| PPG INDUSTRIES INC            | 12      | 19          | 315    | 35,640      | 素材                     |             |  |
| PPL CORPORATION               | 43      | 77          | 221    | 25,010      | 公益事業                   |             |  |
| PTC INC                       | —       | 15          | 188    | 21,323      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| PACCAR INC                    | 19      | 32          | 282    | 31,858      | 資本財                    |             |  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA     | 6       | 7           | 106    | 12,024      | 素材                     |             |  |
| PALO ALTO NETWORKS INC        | 6       | 10          | 534    | 60,306      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| PARKER HANNIFIN CORP          | 7       | 11          | 387    | 43,704      | 資本財                    |             |  |
| PAYCHEX INC                   | 15      | 24          | 295    | 33,363      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| PAYCOM SOFTWARE INC           | 3       | 6           | 306    | 34,640      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| PAYPAL HOLDINGS INC           | 67      | 105         | 2,163  | 244,170     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A     | —       | 31          | 156    | 17,674      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL     | 29      | —           | —      | —           | 銀行                     |             |  |
| PEPSICO INC                   | 78      | 122         | 1,996  | 225,338     | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| PERKINELMER INC               | 9       | 12          | 226    | 25,570      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| PFIZER INC                    | 325     | 515         | 2,435  | 274,926     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   | 89      | 137         | 1,284  | 144,968     | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| PHILLIPS 66                   | 22      | 44          | 356    | 40,199      | エネルギー                  |             |  |
| PINNACLE WEST CAPITAL         | 8       | 14          | 90     | 10,247      | 公益事業                   |             |  |
| PINTEREST INC- CLASS A        | —       | 65          | 305    | 34,456      | メディア・娯楽                |             |  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  | 11      | 24          | 454    | 51,251      | エネルギー                  |             |  |
| POOL CORP                     | —       | 4           | 229    | 25,898      | 小売                     |             |  |
| T. ROWE PRICE GROUP INC       | 12      | 18          | 397    | 44,896      | 各種金融                   |             |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 21      | 32          | 224    | 25,317      | 保険                     |             |  |
| PROCTER & GAMBLE CO           | 144     | 219         | 3,188  | 359,859     | 家庭用品・パーソナル用品           |             |  |
| PROGRESSIVE CORP              | 33      | 50          | 484    | 54,713      | 保険                     |             |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 19      | 39          | 429    | 48,429      | 保険                     |             |  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP  | 28      | 35          | 220    | 24,855      | 公益事業                   |             |  |
| PULTE HOMES INC               | 19      | 29          | 151    | 17,042      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| QORVO INC                     | —       | 11          | 180    | 20,335      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| QUALCOMM INC                  | 66      | 98          | 1,646  | 185,792     | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| QUEST DIAGNOSTICS             | 8       | 11          | 165    | 18,706      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| RPM INTERNATIONAL INC         | 9       | 10          | 94     | 10,652      | 素材                     |             |  |
| RALPH LAUREN CORP             | 3       | —           | —      | —           | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 8       | 20          | 204    | 23,079      | 各種金融                   |             |  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP    | 88      | 145         | 1,325  | 149,590     | 資本財                    |             |  |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc | 6       | 10          | 645    | 72,895      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                        | 業<br>種<br>等 |  |
|-------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|------------------------|-------------|--|
|                               |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |                        |             |  |
|                               |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (アメリカ)                        |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円                     |             |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 74      | 92          | 224    | 25,341      | 銀行                     |             |  |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 4       | —           | —      | —           | 保険                     |             |  |
| REPUBLIC SERVICES INC         | 9       | 16          | 217    | 24,552      | 商業・専門サービス              |             |  |
| RESMED INC                    | 8       | 14          | 379    | 42,847      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A       | 5       | 9           | 232    | 26,263      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| ROBERT HALF INTL INC          | 7       | 13          | 153    | 17,376      | 商業・専門サービス              |             |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 6       | 9           | 307    | 34,736      | 資本財                    |             |  |
| ROKU INC                      | —       | 12          | 358    | 40,478      | メディア・娯楽                |             |  |
| ROLLINS INC                   | 12      | 28          | 101    | 11,414      | 商業・専門サービス              |             |  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 6       | 9           | 488    | 55,120      | 資本財                    |             |  |
| ROSS STORES INC               | 21      | 38          | 459    | 51,877      | 小売                     |             |  |
| S&P GLOBAL INC                | 14      | 21          | 975    | 110,065     | 各種金融                   |             |  |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 7       | 7           | 48     | 5,470       | 各種金融                   |             |  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS    | 19      | 27          | 216    | 24,431      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| SVB FINANCIAL GROUP           | 3       | 5           | 444    | 50,141      | 銀行                     |             |  |
| SALESFORCE.COM INC            | 54      | 91          | 2,835  | 319,967     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| SCHLUMBERGER LTD              | 84      | 147         | 502    | 56,743      | エネルギー                  |             |  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP         | 92      | 141         | 1,140  | 128,747     | 各種金融                   |             |  |
| SEAGEN INC                    | 8       | 16          | 308    | 34,820      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| SEALED AIR CORP               | 14      | 15          | 101    | 11,435      | 素材                     |             |  |
| SEMPRA ENERGY                 | 16      | 27          | 344    | 38,870      | 公益事業                   |             |  |
| SERVICENOW INC                | 11      | 19          | 1,325  | 149,636     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE       | 4       | 22          | 722    | 81,556      | 素材                     |             |  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | 10      | 14          | 245    | 27,753      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| SMITH (A.O.) CORP             | 9       | 12          | 97     | 10,988      | 資本財                    |             |  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM     | 8       | 10          | 135    | 15,338      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| SNAP-ON INC                   | 3       | 5           | 119    | 13,433      | 資本財                    |             |  |
| SNAP INC - A                  | 61      | 100         | 550    | 62,129      | メディア・娯楽                |             |  |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A         | —       | 19          | 745    | 84,093      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC    | —       | 6           | 239    | 27,027      | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| SOUTHERN CO                   | 59      | 85          | 541    | 61,115      | 公益事業                   |             |  |
| SOUTHWEST AIRLINES CO         | 15      | 28          | 147    | 16,628      | 運輸                     |             |  |
| SPLUNK INC                    | 10      | 19          | 336    | 37,945      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| SQUARE INC - A                | 23      | 38          | 893    | 100,849     | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC    | 9       | 15          | 293    | 33,081      | 資本財                    |             |  |
| STARBUCKS CORP                | 68      | 114         | 1,305  | 147,342     | 消費者サービス                |             |  |
| STATE STREET CORP             | 20      | 34          | 330    | 37,293      | 各種金融                   |             |  |
| STEEL DYNAMICS INC            | —       | 25          | 168    | 19,013      | 素材                     |             |  |
| STRYKER CORP                  | 19      | 30          | 836    | 94,409      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| SYNOPSYS INC                  | 10      | 16          | 564    | 63,752      | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 43      | 60          | 298    | 33,707      | 各種金融                   |             |  |
| SYSCO CORP                    | 30      | 50          | 401    | 45,304      | 食品・生活必需品小売             |             |  |
| TJX COMPANIES INC             | 70      | 118         | 828    | 93,535      | 小売                     |             |  |
| T-MOBILE US INC               | 34      | 62          | 747    | 84,316      | 電気通信サービス               |             |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 7       | 13          | 243    | 27,429      | メディア・娯楽                |             |  |
| TARGET CORP                   | 29      | 45          | 1,173  | 132,439     | 小売                     |             |  |
| TELADOC HEALTH INC            | —       | 17          | 256    | 28,949      | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC     | 3       | 5           | 219    | 24,821      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |         | 業<br>種<br>等            |  |
|-------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|---------|------------------------|--|
|                               |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |         |                        |  |
|                               |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |                        |  |
| (アメリカ)                        |         | 百株          | 百株     | 千米ドル        | 千円      |                        |  |
| TELEFLEX INC                  |         | 3           | 5      | 187         | 21,210  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| TERADYNE INC                  |         | —           | 17     | 255         | 28,819  | 半導体・半導体製造装置            |  |
| TESLA INC                     |         | 44          | 75     | 7,756       | 875,351 | 自動車・自動車部品              |  |
| TEXAS INSTRUMENTS             |         | 52          | 80     | 1,544       | 174,284 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| TEXTRON INC                   |         | 15          | 27     | 207         | 23,384  | 資本財                    |  |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A   |         | 3           | 49     | 476         | 53,768  | ソフトウェア・サービス            |  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC  |         | 23          | 36     | 2,270       | 256,213 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| 3M CO                         |         | 32          | 50     | 909         | 102,651 | 資本財                    |  |
| TIFFANY & CO                  |         | 6           | —      | —           | —       | 小売                     |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY        |         | 9           | 13     | 291         | 32,902  | 小売                     |  |
| TRANSIGM GROUP INC            |         | 3           | 5      | 378         | 42,751  | 資本財                    |  |
| TRANSUNION                    |         | 13          | 19     | 226         | 25,561  | 商業・専門サービス              |  |
| TRAVELERS COS INC/THE         |         | 13          | 18     | 291         | 32,845  | 保険                     |  |
| TRIMBLE INC                   |         | 20          | 28     | 255         | 28,793  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| TRUIST FINANCIAL CORP         |         | 78          | 129    | 838         | 94,641  | 銀行                     |  |
| TWILIO INC - A                |         | 8           | 16     | 526         | 59,417  | ソフトウェア・サービス            |  |
| TWITTER INC                   |         | 52          | 85     | 456         | 51,569  | メディア・娯楽                |  |
| TYLER TECHNOLOGIES INC        |         | —           | 5      | 275         | 31,061  | ソフトウェア・サービス            |  |
| TYSON FOODS INC-CL A          |         | 18          | 28     | 230         | 25,963  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| UGI CORP                      |         | —           | 20     | 93          | 10,535  | 公益事業                   |  |
| US BANCORP                    |         | 77          | 140    | 843         | 95,231  | 銀行                     |  |
| UBER TECHNOLOGIES INC         |         | 61          | 126    | 575         | 64,963  | 運輸                     |  |
| ULTA BEAUTY INC               |         | 3           | 6      | 249         | 28,137  | 小売                     |  |
| UNION PACIFIC CORP            |         | 39          | 59     | 1,426       | 161,046 | 運輸                     |  |
| UNITED PARCEL SERVICE CL B    |         | 41          | 65     | 1,385       | 156,323 | 運輸                     |  |
| UNITED RENTALS INC            |         | 6           | 8      | 330         | 37,291  | 資本財                    |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC        |         | 55          | 84     | 3,942       | 444,931 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC |         | 5           | 6      | 83          | 9,407   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| VF CORP                       |         | 18          | 34     | 262         | 29,637  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| VAIL RESORTS INC              |         | 2           | 5      | 200         | 22,677  | 消費者サービス                |  |
| VALERO ENERGY CORP            |         | 25          | 44     | 344         | 38,875  | エネルギー                  |  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC    |         | 6           | —      | —           | —       | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A     |         | 9           | 14     | 477         | 53,899  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| VERISIGN INC                  |         | 6           | 11     | 263         | 29,683  | ソフトウェア・サービス            |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    |         | 235         | 365    | 1,910       | 215,627 | 電気通信サービス               |  |
| VERISK ANALYTICS INC          |         | 8           | 12     | 276         | 31,196  | 商業・専門サービス              |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC    |         | 16          | 26     | 511         | 57,733  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| VIACOMCBS INC-CLASS B         |         | 45          | 73     | 260         | 29,456  | メディア・娯楽                |  |
| VIATRIS INC                   |         | —           | 134    | 196         | 22,149  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES       |         | 97          | 154    | 3,302       | 372,735 | ソフトウェア・サービス            |  |
| VMWARE INC-CLASS A            |         | 6           | 22     | 284         | 32,104  | ソフトウェア・サービス            |  |
| VOYA FINANCIAL INC            |         | 12          | 12     | 82          | 9,317   | 各種金融                   |  |
| VULCAN MATERIALS CO           |         | 7           | 12     | 264         | 29,889  | 素材                     |  |
| WEC ENERGY GROUP INC          |         | 18          | 29     | 263         | 29,742  | 公益事業                   |  |
| WABTEC CORP/DE                |         | 13          | 23     | 228         | 25,740  | 資本財                    |  |
| WALMART INC                   |         | 82          | 136    | 2,051       | 231,484 | 食品・生活必需品小売り            |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC  |         | 39          | 71     | 349         | 39,454  | 食品・生活必需品小売り            |  |
| WASTE CONNECTIONS INC         |         | 15          | 18     | 246         | 27,874  | 商業・専門サービス              |  |

| 銘柄                                  | 期首(前期末)    | 当期末    |        |         |            | 業種等                    |  |
|-------------------------------------|------------|--------|--------|---------|------------|------------------------|--|
|                                     |            | 株数     | 株数     | 評価額     |            |                        |  |
|                                     |            |        |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |  |
| (アメリカ)                              |            | 百株     | 百株     | 千米ドル    | 千円         |                        |  |
| WASTE MANAGEMENT INC                |            | 21     | 34     | 544     | 61,414     | 商業・専門サービス              |  |
| WATERS CORP                         |            | 4      | 5      | 198     | 22,406     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WELLS FARGO & COMPANY               |            | 222    | 387    | 1,932   | 218,089    | 銀行                     |  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC    |            | 5      | 8      | 346     | 39,118     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WESTERN DIGITAL CORP                |            | 20     | 34     | 192     | 21,673     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| WESTERN UNION CO                    |            | 27     | 43     | 78      | 8,894      | ソフトウェア・サービス            |  |
| WESTROCK CO                         |            | 19     | 31     | 151     | 17,137     | 素材                     |  |
| WHIRLPOOL CORP                      |            | 4      | 6      | 139     | 15,717     | 耐久消費財・アパレル             |  |
| WILLIAMS COS INC                    |            | 77     | 105    | 299     | 33,821     | エネルギー                  |  |
| WORKDAY INC-CLASS A                 |            | 11     | 19     | 584     | 65,979     | ソフトウェア・サービス            |  |
| XCEL ENERGY INC                     |            | 29     | 45     | 287     | 32,415     | 公益事業                   |  |
| XILINX INC                          |            | 14     | 24     | 500     | 56,475     | 半導体・半導体製造装置            |  |
| XYLEM INC                           |            | 11     | 17     | 228     | 25,841     | 資本財                    |  |
| YUM! BRANDS INC                     |            | 16     | 28     | 357     | 40,318     | 消費者サービス                |  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A        |            | 3      | 5      | 308     | 34,826     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC          |            | 12     | 19     | 267     | 30,195     | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| ZOETIS INC                          |            | 29     | 44     | 969     | 109,432    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A         |            | 9      | 22     | 571     | 64,508     | ソフトウェア・サービス            |  |
| INVESCO LTD                         |            | 35     | 52     | 136     | 15,396     | 各種金融                   |  |
| CHUBB LTD                           |            | 25     | 37     | 733     | 82,797     | 保険                     |  |
| LyondellBasell Industries NV        |            | 16     | 26     | 248     | 27,998     | 素材                     |  |
| GARMIN LTD                          |            | 9      | 11     | 172     | 19,515     | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ACCENTURE PLC-CL A                  |            | 36     | 57     | 2,102   | 237,306    | ソフトウェア・サービス            |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV               |            | 18     | 26     | 589     | 66,585     | 半導体・半導体製造装置            |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY                  |            | 13     | —      | —       | —          | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| TE CONNECTIVITY LTD                 |            | 18     | 28     | 451     | 50,950     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| APTIV PLC                           |            | 17     | 28     | 484     | 54,735     | 自動車・自動車部品              |  |
| EATON CORP PLC                      |            | 22     | 33     | 586     | 66,213     | 資本財                    |  |
| IHS MARKIT LTD                      |            | 23     | 36     | 463     | 52,265     | 商業・専門サービス              |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC            |            | 7      | 11     | 279     | 31,528     | 保険                     |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING        |            | 15     | 19     | 116     | 13,157     | 資本財                    |  |
| ALLEGION PLC                        |            | —      | 8      | 106     | 12,005     | 資本財                    |  |
| STERIS PLC                          |            | 6      | 10     | 241     | 27,213     | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| PERRIGO CO PLC                      |            | 11     | —      | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| AMCOR PLC                           |            | 104    | 148    | 183     | 20,696     | 素材                     |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC              |            | 13     | 22     | 419     | 47,382     | 資本財                    |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS         |            | —      | 22     | 221     | 25,000     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| AON PLC                             |            | 13     | 20     | 612     | 69,072     | 保険                     |  |
| PENTAIR PLC                         |            | 12     | 14     | 111     | 12,539     | 資本財                    |  |
| MEDTRONIC PLC                       |            | 77     | 120    | 1,474   | 166,461    | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| MYLAN NV                            |            | 34     | —      | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL      |            | 42     | 59     | 457     | 51,595     | 資本財                    |  |
| COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC |            | 15     | 25     | 149     | 16,817     | 食品・飲料・タバコ              |  |
| LINDE PLC                           |            | 30     | 47     | 1,623   | 183,172    | 素材                     |  |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A          |            | 11     | 18     | 160     | 18,145     | 保険                     |  |
| 小計                                  | 株数・金額      | 17,628 | 28,135 | 381,613 | 43,068,869 |                        |  |
|                                     | 銘柄数 < 比率 > | 495    | 522    | —       | <69.7%>    |                        |  |

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |             | 業<br>種<br>等 |  |
|------------------------------|---------|-------------|--------|-------------|-------------|-------------|--|
|                              |         | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 |             |             |  |
|                              |         |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額      |             |  |
| (カナダ)                        |         | 百株          | 百株     | 千カナダドル      | 千円          |             |  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 18      | 30          | 207    | 18,835      | 素材          |             |  |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | —       | 100         | 177    | 16,117      | 公益事業        |             |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 52      | 80          | 402    | 36,533      | 食品・生活必需品小売り |             |  |
| BCE INC                      | 15      | 19          | 123    | 11,161      | 電気通信サービス    |             |  |
| BANK OF MONTREAL             | 35      | 59          | 825    | 74,913      | 銀行          |             |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 62      | 100         | 833    | 75,601      | 銀行          |             |  |
| BARRICK GOLD CORP            | 117     | 169         | 414    | 37,591      | 素材          |             |  |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 84      | 129         | 986    | 89,473      | 各種金融        |             |  |
| CAE INC                      | 27      | 46          | 196    | 17,800      | 資本財         |             |  |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 13      | 17          | 120    | 10,966      | 素材          |             |  |
| CGI INC                      | 13      | 18          | 211    | 19,184      | ソフトウェア・サービス |             |  |
| CAMECO CORP                  | 35      | 63          | 218    | 19,812      | エネルギー       |             |  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 23      | 38          | 564    | 51,225      | 銀行          |             |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 39      | 67          | 1,111  | 100,844     | 運輸          |             |  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 75      | 122         | 663    | 60,176      | エネルギー       |             |  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 7       | 62          | 606    | 55,050      | 運輸          |             |  |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A     | 5       | 8           | 151    | 13,775      | 小売          |             |  |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 17      | 34          | 122    | 11,075      | 公益事業        |             |  |
| CENOVUS ENERGY INC           | 113     | 186         | 304    | 27,650      | エネルギー       |             |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 1       | 2           | 485    | 44,077      | ソフトウェア・サービス |             |  |
| DOLLARAMA INC                | 21      | 31          | 182    | 16,509      | 小売          |             |  |
| EMERA INC                    | 22      | 27          | 159    | 14,503      | 公益事業        |             |  |
| ENBRIDGE INC                 | 117     | 187         | 988    | 89,620      | エネルギー       |             |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 2       | 2           | 130    | 11,844      | 保険          |             |  |
| FORTIS INC                   | 30      | 42          | 241    | 21,931      | 公益事業        |             |  |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 13      | 19          | 344    | 31,280      | 素材          |             |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 17      | 32          | 167    | 15,205      | 耐久消費財・アパレル  |             |  |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 25      | 28          | 108    | 9,814       | 保険          |             |  |
| HYDRO ONE LTD                | 34      | 40          | 122    | 11,114      | 公益事業        |             |  |
| IGM FINANCIAL INC            | 14      | 20          | 105    | 9,545       | 各種金融        |             |  |
| IMPERIAL OIL LTD             | 27      | 46          | 203    | 18,423      | エネルギー       |             |  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 10      | 17          | 294    | 26,740      | 保険          |             |  |
| INTER PIPELINE LTD           | 52      | —           | —      | —           | エネルギー       |             |  |
| KEYERA CORP                  | 27      | 46          | 143    | 13,025      | エネルギー       |             |  |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD       | 22      | 35          | 195    | 17,720      | 素材          |             |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 15      | 15          | 154    | 14,056      | 食品・生活必需品小売り |             |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 19      | 30          | 320    | 29,110      | 自動車・自動車部品   |             |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 104     | 170         | 423    | 38,375      | 保険          |             |  |
| METRO INC                    | 22      | 22          | 149    | 13,543      | 食品・生活必需品小売り |             |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 21      | 34          | 360    | 32,652      | 銀行          |             |  |
| NUTRIEN LTD                  | 34      | 58          | 498    | 45,212      | 素材          |             |  |
| OPEN TEXT CORP               | 25      | 35          | 231    | 21,030      | ソフトウェア・サービス |             |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 44      | 63          | 272    | 24,756      | エネルギー       |             |  |
| POWER CORP OF CANADA         | 47      | 61          | 264    | 23,993      | 保険          |             |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 23      | 38          | 274    | 24,928      | 消費者サービス     |             |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B  | 28      | 41          | 254    | 23,105      | 電気通信サービス    |             |  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 78      | 123         | 1,636  | 148,404     | 銀行          |             |  |
| SAPUTO INC                   | 19      | 49          | 154    | 14,047      | 食品・飲料・タバコ   |             |  |

| 銘柄                             | 期首(前期末)  | 当期末   |       |        |           | 業種等                    |  |
|--------------------------------|----------|-------|-------|--------|-----------|------------------------|--|
|                                |          | 株数    | 株数    | 評価額    |           |                        |  |
|                                |          |       |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |  |
| (カナダ)                          |          | 百株    | 百株    | 千カナダドル | 千円        |                        |  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B      |          | 45    | 58    | 214    | 19,476    | メディア・娯楽                |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A          |          | 6     | 10    | 2,105  | 190,978   | ソフトウェア・サービス            |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC         |          | 29    | 40    | 291    | 26,424    | 保険                     |  |
| SUNCOR ENERGY INC              |          | 98    | 165   | 540    | 49,034    | エネルギー                  |  |
| TC ENERGY CORP                 |          | 54    | 88    | 554    | 50,250    | エネルギー                  |  |
| TELUS CORP                     |          | 16    | 16    | 46     | 4,241     | 電気通信サービス               |  |
| THOMSON REUTERS CORP           |          | 13    | 18    | 284    | 25,788    | 商業・専門サービス              |  |
| TORONTO-DOMINION BANK          |          | 98    | 159   | 1,463  | 132,769   | 銀行                     |  |
| WSP GLOBAL INC                 |          | —     | 16    | 277    | 25,147    | 資本財                    |  |
| WESTON (GEORGE) LTD            |          | 5     | 11    | 159    | 14,470    | 食品・生活必需品小売り            |  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP   |          | 33    | 56    | 297    | 26,977    | 素材                     |  |
| 小計                             | 株数・金額    | 2,086 | 3,324 | 23,350 | 2,117,923 |                        |  |
| 銘柄                             | 銘柄数 <比率> | 57    | 58    | —      | <3.4%>    |                        |  |
| (ヨーロッパ)                        |          | 千ユーロ  |       |        |           |                        |  |
| ADIDAS AG                      |          | 10    | 17    | 513    | 67,230    | 耐久消費財・アパレル             |  |
| Fresenius SE & CO KG           |          | 23    | 37    | 140    | 18,342    | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE   |          | 12    | 23    | 82     | 10,750    | 電気通信サービス               |  |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF        |          | 6     | —     | —      | —         | 素材                     |  |
| HANNOVER RUECK SE              |          | 4     | 4     | 74     | 9,697     | 保険                     |  |
| GEA GROUP AG                   |          | 14    | 26    | 116    | 15,282    | 資本財                    |  |
| CONTINENTAL AG                 |          | 7     | 9     | 99     | 12,988    | 自動車・自動車部品              |  |
| DEUTSCHE POST AG               |          | 54    | 83    | 469    | 61,389    | 運輸                     |  |
| MERCK KGAA                     |          | 8     | 12    | 255    | 33,367    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| RWE AG                         |          | 37    | 70    | 227    | 29,726    | 公益事業                   |  |
| SAP SE                         |          | 61    | 95    | 1,221  | 159,873   | ソフトウェア・サービス            |  |
| E.ON SE                        |          | 120   | 213   | 234    | 30,732    | 公益事業                   |  |
| HENKEL AG & CO KGAA            |          | 9     | 10    | 75     | 9,868     | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| PUMA AG                        |          | 7     | 9     | 110    | 14,427    | 耐久消費財・アパレル             |  |
| BAYER AG                       |          | 58    | 94    | 478    | 62,538    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG   |          | 6     | 10    | 80     | 10,534    | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| BASF SE                        |          | 47    | 74    | 458    | 59,953    | 素材                     |  |
| BEIERSDORF AG                  |          | 7     | 8     | 75     | 9,875     | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| HEIDELBERGCEMENT AG            |          | 10    | 13    | 84     | 11,110    | 素材                     |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co |          | 12    | 17    | 100    | 13,135    | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| ALLIANZ SE                     |          | 22    | 34    | 704    | 92,187    | 保険                     |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG     |          | 7     | 11    | 291    | 38,141    | 保険                     |  |
| VOLKSWAGEN AG                  |          | 3     | 4     | 142    | 18,619    | 自動車・自動車部品              |  |
| VOLKSWAGEN AG PFD              |          | 8     | 15    | 282    | 37,005    | 自動車・自動車部品              |  |
| DAIMLER AG                     |          | 51    | 76    | 671    | 87,894    | 自動車・自動車部品              |  |
| SIEMENS AG                     |          | 43    | 73    | 1,070  | 139,990   | 資本財                    |  |
| DEUTSCHE BANK AG -REG          |          | 139   | 211   | 232    | 30,353    | 各種金融                   |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG    |          | 17    | 30    | 277    | 36,247    | 自動車・自動車部品              |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG        |          | 169   | 293   | 485    | 63,466    | 電気通信サービス               |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG            |          | 2     | 3     | 196    | 25,678    | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG       |          | 78    | 130   | 546    | 71,435    | 半導体・半導体製造装置            |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG             |          | 10    | 15    | 225    | 29,485    | 各種金融                   |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE   |          | 11    | 16    | 142    | 18,677    | 自動車・自動車部品              |  |
| LANXESS                        |          | 7     | 15    | 86     | 11,266    | 素材                     |  |

| 銘柄                                  | 期首(前期末) | 当期末   |       |         |                       | 業種等 |  |
|-------------------------------------|---------|-------|-------|---------|-----------------------|-----|--|
|                                     |         | 株数    | 株数    | 評価額     |                       |     |  |
|                                     |         |       |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額                |     |  |
| (ユーロ…ドイツ)                           |         | 百株    | 百株    | 千ユーロ    | 千円                    |     |  |
| MTU AERO ENGINES AG                 | 4       | 6     | 137   | 17,988  | 資本財                   |     |  |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR               | 19      | —     | —     | —       | 不動産                   |     |  |
| SYMRISE AG                          | 8       | 10    | 131   | 17,233  | 素材                    |     |  |
| BRENNTAG SE                         | 10      | 14    | 112   | 14,726  | 資本財                   |     |  |
| EVONIK INDUSTRIES AG                | 11      | 11    | 33    | 4,337   | 素材                    |     |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI        | 117     | 262   | 64    | 8,405   | 電気通信サービス              |     |  |
| COMMERZBANK AG                      | 93      | 181   | 121   | 15,930  | 銀行                    |     |  |
| LEG IMMOBILIEN SE                   | 5       | 6     | 80    | 10,563  | 不動産                   |     |  |
| VONOVIA SE                          | 29      | 49    | 260   | 34,067  | 不動産                   |     |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG             | —       | 29    | 176   | 23,057  | ヘルスケア機器・サービス          |     |  |
| METRO AG                            | 22      | —     | —     | —       | 食品・生活必需品小売            |     |  |
| TEAMVIEWER AG                       | 13      | 59    | 86    | 11,278  | ソフトウェア・サービス           |     |  |
| SIEMENS ENERGY AG                   | 33      | 57    | 140   | 18,404  | 資本財                   |     |  |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF              | —       | 9     | 38    | 5,060   | 素材                    |     |  |
| ZALANDO SE                          | 12      | 28    | 215   | 28,131  | 小売                    |     |  |
| SCOUT24 SE                          | 9       | 18    | 115   | 15,143  | メディア・娯楽               |     |  |
| COVESTRO AG                         | 13      | 15    | 88    | 11,528  | 素材                    |     |  |
| UNIPER SE                           | 15      | 22    | 86    | 11,275  | 公益事業                  |     |  |
| DELIVERY HERO SE                    | 10      | 20    | 223   | 29,262  | 小売                    |     |  |
| 小計                                  | 株数・金額   | 1,529 | 2,569 | 12,364  | 1,617,670             |     |  |
| 銘柄                                  | 比率      | 51    | 50    | —       | <2.6%>                |     |  |
| (ユーロ…イタリア)                          |         |       |       |         |                       |     |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI              | 68      | 68    | 130   | 17,058  | 保険                    |     |  |
| INTESA SANPAOLO                     | 957     | 1,488 | 367   | 48,126  | 銀行                    |     |  |
| MEDIOBANCA SPA                      | 80      | 80    | 86    | 11,319  | 銀行                    |     |  |
| ENEL SPA                            | 491     | 765   | 542   | 71,003  | 公益事業                  |     |  |
| ENI SPA                             | 158     | 180   | 227   | 29,737  | エネルギー                 |     |  |
| SNAM SPA                            | —       | 250   | 125   | 16,392  | 公益事業                  |     |  |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA  | 128     | 151   | 100   | 13,187  | 公益事業                  |     |  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA         | 11      | 21    | 117   | 15,422  | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| Prysmian SpA                        | —       | 32    | 108   | 14,159  | 資本財                   |     |  |
| MONCLER SPA                         | 15      | 22    | 148   | 19,382  | 耐久消費財・アパレル            |     |  |
| FINECOBANK SPA                      | 54      | 71    | 121   | 15,945  | 銀行                    |     |  |
| UNICREDIT SPA                       | 163     | 234   | 266   | 34,906  | 銀行                    |     |  |
| POSTE ITALIANE SPA                  | 68      | 95    | 118   | 15,537  | 保険                    |     |  |
| 小計                                  | 株数・金額   | 2,198 | 3,462 | 2,462   | 322,180               |     |  |
| 銘柄                                  | 比率      | 11    | 13    | —       | <0.5%>                |     |  |
| (ユーロ…フランス)                          |         |       |       |         |                       |     |  |
| BOUYGUES                            | 15      | 22    | 74    | 9,764   | 資本財                   |     |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 37      | 73    | 218   | 28,633  | 公益事業                  |     |  |
| L'OREAL                             | 13      | 21    | 892   | 116,823 | 家庭用品・パーソナル用品          |     |  |
| LVMH MOËT HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 16      | 25    | 1,805 | 236,244 | 耐久消費財・アパレル            |     |  |
| THALES SA                           | 7       | 9     | 81    | 10,718  | 資本財                   |     |  |
| CAPGEMINI                           | 10      | 17    | 361   | 47,306  | ソフトウェア・サービス           |     |  |
| PUBLICIS GROUPE                     | —       | 20    | 118   | 15,537  | メディア・娯楽               |     |  |
| MICHELIN (CGDE)-B                   | 7       | 10    | 144   | 18,865  | 自動車・自動車部品             |     |  |
| PERNOD-RICARD                       | 10      | 16    | 329   | 43,136  | 食品・飲料・タバコ             |     |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 30      | 47    | 725   | 94,907  | 資本財                   |     |  |

| 銘柄                        | 期首(前期末)    | 当期末   |       |         |           | 業種等                    |
|---------------------------|------------|-------|-------|---------|-----------|------------------------|
|                           |            | 株数    | 株数    | 評価額     | 外貨建額邦貨換算額 |                        |
| (ユーロ…フランス)                | 百株         | 百株    | 千ユーロ  | 千円      |           |                        |
| VIVENDI SA                | 43         | 52    | 57    | 7,560   |           | メディア・娯楽                |
| ORANGE                    | 92         | 125   | 120   | 15,810  |           | 電気通信サービス               |
| HERMES INTERNATIONAL      | 1          | 2     | 386   | 50,507  |           | 耐久消費財・アパレル             |
| DASSAULT SYSTEMES SA      | 8          | —     | —     | —       |           | ソフトウェア・サービス            |
| KERING                    | 4          | 7     | 489   | 64,054  |           | 耐久消費財・アパレル             |
| CNP ASSURANCES            | 25         | 42    | 93    | 12,185  |           | 保険                     |
| CARREFOUR SA              | 39         | 52    | 82    | 10,817  |           | 食品・生活必需品小売             |
| ATOS SE                   | 7          | 21    | 93    | 12,268  |           | ソフトウェア・サービス            |
| SANOFI                    | 66         | 96    | 856   | 112,044 |           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCOR SA                  | 19         | —     | —     | —       |           | 消費者サービス                |
| SOCIETE GENERALE-A        | 63         | 86    | 255   | 33,420  |           | 銀行                     |
| EUROFINS SCIENTIFIC       | 1          | —     | —     | —       |           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELEPERFORMANCE           | 3          | 5     | 201   | 26,339  |           | 商業・専門サービス              |
| SODEXO                    | 8          | 16    | 135   | 17,765  |           | 消費者サービス                |
| AXA SA                    | 89         | 151   | 384   | 50,282  |           | 保険                     |
| PEUGEOT SA                | 38         | —     | —     | —       |           | 自動車・自動車部品              |
| ESSILORLUXOTTICA          | 16         | 27    | 498   | 65,246  |           | 耐久消費財・アパレル             |
| CREDIT AGRICOLE SA        | 81         | 124   | 162   | 21,303  |           | 銀行                     |
| BNP PARIBAS               | 62         | 103   | 608   | 79,661  |           | 銀行                     |
| ORPEA                     | 5          | 9     | 87    | 11,468  |           | ヘルスケア機器・サービス           |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 30         | 45    | 273   | 35,724  |           | 資本財                    |
| Wendel                    | 3          | 5     | 64    | 8,499   |           | 各種金融                   |
| SAFRAN SA                 | 19         | 34    | 411   | 53,859  |           | 資本財                    |
| ENGIE                     | 106        | 163   | 208   | 27,224  |           | 公益事業                   |
| ALSTOM                    | 15         | 47    | 150   | 19,665  |           | 資本財                    |
| ELECTRICITE DE FRANCE     | 45         | 90    | 117   | 15,344  |           | 公益事業                   |
| Legrand SA                | 13         | 17    | 168   | 22,016  |           | 資本財                    |
| Eiffage SA                | 6          | 8     | 78    | 10,284  |           | 資本財                    |
| TOTALENERGIES SE          | 139        | 214   | 934   | 122,223 |           | エネルギー                  |
| Aeroports de Paris        | 2          | 8     | 100   | 13,125  |           | 運輸                     |
| Natixis                   | 92         | —     | —     | —       |           | 各種金融                   |
| UBISOFT ENTERTAINMENT     | 7          | 20    | 94    | 12,365  |           | メディア・娯楽                |
| SCOR SE                   | 12         | 30    | 86    | 11,319  |           | 保険                     |
| VINCI S.A.                | 27         | 48    | 459   | 60,171  |           | 資本財                    |
| DANONE                    | 30         | 54    | 311   | 40,812  |           | 食品・飲料・タバコ              |
| AIR LIQUIDE               | 25         | 39    | 588   | 77,053  |           | 素材                     |
| Bureau Veritas SA         | 23         | 23    | 68    | 8,901   |           | 商業・専門サービス              |
| GETLINK SE                | 40         | 65    | 91    | 11,935  |           | 運輸                     |
| SUEZ                      | 36         | 42    | 83    | 10,913  |           | 公益事業                   |
| EDENRED                   | 19         | 25    | 113   | 14,846  |           | ソフトウェア・サービス            |
| VALEO SA                  | 19         | 38    | 106   | 13,897  |           | 自動車・自動車部品              |
| DASSAULT SYSTEMES SE      | —          | 74    | 406   | 53,238  |           | ソフトウェア・サービス            |
| EUROFINS SCIENTIFIC       | —          | 16    | 169   | 22,155  |           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WORLDLINE SA              | 16         | 31    | 157   | 20,587  |           | ソフトウェア・サービス            |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH  | 2          | 3     | 172   | 22,533  |           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 小計                        | 株数・金額      | 1,566 | 2,340 | 14,686  | 1,921,378 |                        |
|                           | 銘柄数 < 比率 > | 52    | 50    | —       | <3.1%>    |                        |

| 銘柄                             | 期首(前期末) | 当期末   |       |         |                        | 業種等 |  |
|--------------------------------|---------|-------|-------|---------|------------------------|-----|--|
|                                |         | 株数    | 株数    | 評価額     |                        |     |  |
|                                |         |       |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額                 |     |  |
| (ユーロ…オランダ)                     |         | 百株    | 百株    | 千ユーロ    | 千円                     |     |  |
| AIRBUS SE                      | 36      | 56    | 655   | 85,708  | 資本財                    |     |  |
| ASM INTERNATIONAL NV           | —       | 6     | 256   | 33,532  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| RANDSTAD NV                    | 11      | 13    | 83    | 10,900  | 商業・専門サービス              |     |  |
| WOLTERS KLUWER                 | 12      | 17    | 166   | 21,830  | 商業・専門サービス              |     |  |
| Koninklijke Vopak NV           | 5       | 5     | 19    | 2,485   | エネルギー                  |     |  |
| AEGON NV                       | 152     | 232   | 99    | 13,005  | 保険                     |     |  |
| KONINKLIJKE KPN NV             | 285     | 359   | 94    | 12,299  | 電気通信サービス               |     |  |
| STMICROELECTRONICS NV          | 41      | 63    | 280   | 36,702  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV         | 53      | 79    | 330   | 43,185  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| HEINEKEN NV                    | 12      | 22    | 212   | 27,759  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| HEINEKEN HOLDING NV            | 7       | 10    | 86    | 11,307  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| KONINKLIJKE DSM NV             | 9       | 13    | 249   | 32,597  | 素材                     |     |  |
| UNILEVER NV                    | 82      | —     | —     | —       | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| ASML HOLDING NV                | 25      | 39    | 2,882 | 377,073 | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| KONINKLIJKE AHOOLD DELHAIZE NV | 61      | 73    | 209   | 27,460  | 食品・生活必需品小売             |     |  |
| FERRARI NV                     | 6       | 11    | 258   | 33,761  | 自動車・自動車部品              |     |  |
| CNH INDUSTRIAL NV              | 91      | 130   | 196   | 25,671  | 資本財                    |     |  |
| AKZO NOBEL                     | 10      | 13    | 134   | 17,633  | 素材                     |     |  |
| PROSUS NV                      | 30      | 93    | 681   | 89,100  | 小売                     |     |  |
| STELLANTIS NV                  | —       | 190   | 332   | 43,548  | 自動車・自動車部品              |     |  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV       | 67      | 83    | 106   | 13,974  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| NN GROUP NV                    | 24      | 26    | 122   | 16,024  | 保険                     |     |  |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV       | —       | 79    | 211   | 27,624  | メディア・娯楽                |     |  |
| EXOR NV                        | —       | 10    | 83    | 10,955  | 各種金融                   |     |  |
| QIAGEN NV                      | 18      | 24    | 111   | 14,652  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| ADYEN NV /WI                   | 1       | 2     | 531   | 69,552  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| ING GROEP NV-CVA               | 247     | 396   | 521   | 68,243  | 銀行                     |     |  |
| 小計                             | 株数・金額   | 1,297 | 2,055 | 8,916   | 1,166,595              |     |  |
| 銘柄                             | 比率      | 23    | 26    | —       | <1.9%>                 |     |  |
| (ユーロ…スペイン)                     |         |       |       |         |                        |     |  |
| ENDESA SA                      | 23      | 37    | 72    | 9,514   | 公益事業                   |     |  |
| Bankinter SA                   | 80      | —     | —     | —       | 銀行                     |     |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA   | 360     | 603   | 360   | 47,196  | 銀行                     |     |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA        | 19      | 30    | 70    | 9,249   | 公益事業                   |     |  |
| REPSOL SA                      | 97      | 128   | 138   | 18,134  | エネルギー                  |     |  |
| BANCO SANTANDER S.A.           | 873     | 1,547 | 494   | 64,632  | 銀行                     |     |  |
| TELEFONICA SA                  | 259     | 468   | 179   | 23,419  | 電気通信サービス               |     |  |
| ENAGAS SA                      | 13      | 48    | 95    | 12,441  | 公益事業                   |     |  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV    | 22      | 44    | 103   | 13,530  | 資本財                    |     |  |
| FERROVIAL SA                   | 37      | 53    | 144   | 18,898  | 資本財                    |     |  |
| MAPFRE S.A.                    | 109     | —     | —     | —       | 保険                     |     |  |
| CajaBank SA                    | 253     | 385   | 95    | 12,528  | 銀行                     |     |  |
| IBERDROLA SA                   | 324     | 529   | 535   | 70,031  | 公益事業                   |     |  |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS      | 27      | 47    | 302   | 39,534  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA   | 25      | 25    | 45    | 5,916   | 公益事業                   |     |  |
| FERROVIAL SA-RTS               | —       | 53    | 1     | 218     | 資本財                    |     |  |
| FERROVIAL SA-RTS               | 37      | —     | —     | —       | 資本財                    |     |  |
| INDITEX                        | 54      | 101   | 323   | 42,376  | 小売                     |     |  |

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当期末   |    |       |         | 業種等                    |  |
|-----------------------------|---------|-------|----|-------|---------|------------------------|--|
|                             |         | 株数    | 株数 | 評価額   |         |                        |  |
|                             |         |       |    | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |  |
| (ユーロ…スペイン)                  |         | 百株    | 百株 | 千ユーロ  | 千円      |                        |  |
| AENA SME SA                 | 4       | 7     |    | 117   | 15,423  | 運輸                     |  |
| CELLNEX TELECOM SAU         | 24      | 58    |    | 312   | 40,916  | 電気通信サービス               |  |
| GRIFOLS SA                  | 24      | 43    |    | 79    | 10,431  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| 小計                          | 2,673   | 4,215 |    | 3,473 | 454,397 |                        |  |
| 銘柄数<比率>                     | 20      | 18    |    |       | <0.7%>  |                        |  |
| (ユーロ…ベルギー)                  |         |       |    |       |         |                        |  |
| KBC GROEP NV                | 18      | 29    |    | 247   | 32,428  | 銀行                     |  |
| SOLVAY SA                   | 6       | 8     |    | 93    | 12,194  | 素材                     |  |
| UCB SA                      | 10      | 14    |    | 157   | 20,572  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| COLRUYT SA                  | 6       | 6     |    | 28    | 3,740   | 食品・生活必需品小売り            |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 8       | 8     |    | 93    | 12,167  | 各種金融                   |  |
| AGEAS                       | 13      | 21    |    | 89    | 11,748  | 保険                     |  |
| UMICORE                     | 15      | 22    |    | 112   | 14,777  | 素材                     |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV  | 46      | 73    |    | 383   | 50,145  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| 小計                          | 125     | 186   |    | 1,205 | 157,775 |                        |  |
| 銘柄数<比率>                     | 8       | 8     |    | —     | <0.3%>  |                        |  |
| (ユーロ…オーストリア)                |         |       |    |       |         |                        |  |
| OMV AG                      | 21      | 24    |    | 128   | 16,829  | エネルギー                  |  |
| ERSTE GROUP BANK AG         | 25      | 40    |    | 165   | 21,677  | 銀行                     |  |
| ANDRITZ AG                  | 6       | —     |    | —     | —       | 資本財                    |  |
| 小計                          | 53      | 64    |    | 294   | 38,507  |                        |  |
| 銘柄数<比率>                     | 3       | 2     |    | —     | <0.1%>  |                        |  |
| (ユーロ…ルクセンブルク)               |         |       |    |       |         |                        |  |
| TENARIS SA                  | 42      | 95    |    | 104   | 13,610  | エネルギー                  |  |
| SES SA                      | 42      | —     |    | —     | —       | メディア・娯楽                |  |
| AROUNDOWN SA                | 93      | 191   |    | 118   | 15,550  | 不動産                    |  |
| ARCELORMITTAL               | 61      | 67    |    | 188   | 24,654  | 素材                     |  |
| 小計                          | 240     | 354   |    | 411   | 53,814  |                        |  |
| 銘柄数<比率>                     | 4       | 3     |    | —     | <0.1%>  |                        |  |
| (ユーロ…フィンランド)                |         |       |    |       |         |                        |  |
| KESKO OYJ-B SHS             | —       | 41    |    | 120   | 15,720  | 食品・生活必需品小売り            |  |
| WARTSILA                    | 32      | 84    |    | 106   | 13,887  | 資本財                    |  |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 26      | 40    |    | 125   | 16,442  | 素材                     |  |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        | 41      | 46    |    | 66    | 8,713   | 素材                     |  |
| SAMPO OYJ-A SHS             | 24      | 42    |    | 189   | 24,768  | 保険                     |  |
| FORTUM OYJ                  | 28      | 52    |    | 135   | 17,779  | 公益事業                   |  |
| ELISA OYJ                   | 10      | 12    |    | 64    | 8,459   | 電気通信サービス               |  |
| NOKIA OYJ                   | 318     | 535   |    | 270   | 35,352  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| NESTE OYJ                   | 25      | 37    |    | 183   | 24,044  | エネルギー                  |  |
| KONE OYJ-B                  | 18      | 27    |    | 162   | 21,308  | 資本財                    |  |
| ORION OYJ                   | 10      | 19    |    | 75    | 9,860   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| 小計                          | 536     | 939   |    | 1,500 | 196,338 |                        |  |
| 銘柄数<比率>                     | 10      | 11    |    | —     | <0.3%>  |                        |  |
| (ユーロ…アイルランド)                |         |       |    |       |         |                        |  |
| CRH PLC(DUBLIN)             | 39      | 56    |    | 248   | 32,459  | 素材                     |  |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 11      | 13    |    | 139   | 18,292  | 資本財                    |  |
| KERRY GROUP PLC-A           | 8       | 12    |    | 145   | 18,999  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | —       | 25    |    | 113   | 14,911  | 素材                     |  |

| 銘柄   |                  | 期首(前期末)         |                 | 当期末              |                            | 業種等                         |
|--|------------------|-----------------|-----------------|------------------|----------------------------|-----------------------------|
|  |                  | 株数              | 株数              | 評価額              | 外貨建金額                      |                             |
| (ユーロ…アイルランド)<br>FLUTTER ENTERTAINMENT PLC  |                  | 百株<br>10        | 百株<br>18        | 千ユーロ<br>275      | 千円<br>36,052               | 消費者サービス                     |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 69              | 127             | 922              | 120,715                    |                             |
| (ユーロ…ポルトガル)<br>ENERGIAS DE PORTUGAL SA<br>Galp Energia SGPS SA<br>JERONIMO MARTINS |                  | 218<br>26<br>18 | 307<br>89<br>50 | 145<br>79<br>105 | 19,097<br>10,373<br>13,770 | 公益事業<br>エネルギー<br>食品・生活必需品小売 |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 264<br>3        | 447<br>3        | 330              | 43,241                     |                             |
| ユーロ計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 10,556<br>189   | 16,764<br>189   | 46,568<br>—      | 6,092,615<br><9.9%>        |                             |
| (イギリス)   |                  |                 |                 | 千英ポンド            |                            |                             |
| ASHTEAD GROUP PLC  |                  | 31              | 46              | 289              | 44,231                     | 資本財                         |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC   |                  | —               | 90              | 58               | 8,948                      | 耐久消費財・アパレル                  |
| AVIVA PLC  |                  | 229             | 324             | 128              | 19,631                     | 保険                          |
| DIAGEO PLC   |                  | 130             | 199             | 747              | 114,314                    | 食品・飲料・タバコ                   |
| SCHRODERS PLC  |                  | 12              | 22              | 82               | 12,684                     | 各種金融                        |
| DCC PLC  |                  | —               | 17              | 102              | 15,712                     | 資本財                         |
| BAE SYSTEMS PLC  |                  | 179             | 230             | 130              | 19,996                     | 資本財                         |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC   |                  | 132             | 192             | 489              | 74,941                     | 食品・飲料・タバコ                   |
| HALMA PLC  |                  | 29              | 35              | 106              | 16,220                     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器          |
| STANDARD CHARTERED PLC   |                  | 171             | 249             | 111              | 17,115                     | 銀行                          |
| IMPERIAL BRANDS PLC  |                  | 57              | 77              | 118              | 18,151                     | 食品・飲料・タバコ                   |
| HSBC HOLDINGS PLC  |                  | 1,179           | 1,858           | 798              | 122,137                    | 銀行                          |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC  |                  | 418             | 682             | 197              | 30,178                     | 保険                          |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS  |                  | 193             | —               | —                | —                          | 食品・生活必需品小売                  |
| Associated British Foods PLC   |                  | 21              | 46              | 93               | 14,272                     | 食品・飲料・タバコ                   |
| PERSIMMON PLC  |                  | 21              | 29              | 78               | 11,990                     | 耐久消費財・アパレル                  |
| PRUDENTIAL PLC   |                  | 146             | 256             | 378              | 57,973                     | 保険                          |
| RIO TINTO PLC  |                  | 66              | 103             | 459              | 70,262                     | 素材                          |
| ST JAMES'S PLACE PLC   |                  | 50              | 69              | 110              | 16,870                     | 各種金融                        |
| SSE PLC  |                  | 68              | 100             | 161              | 24,761                     | 公益事業                        |
| BP PLC   |                  | 1,153           | 1,854           | 638              | 97,711                     | エネルギー                       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC   |                  | 3,755           | 6,352           | 307              | 47,009                     | 銀行                          |
| TESCO PLC  |                  | 495             | —               | —                | —                          | 食品・生活必需品小売                  |
| SMITH & NEPHEW PLC   |                  | 50              | 80              | 106              | 16,284                     | ヘルスケア機器・サービス                |
| GLAXOSMITHKLINE PLC  |                  | 289             | 424             | 661              | 101,219                    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス      |
| ASTRAZENECA PLC  |                  | 79              | 144             | 1,338            | 204,757                    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス      |
| BT GROUP PLC   |                  | 572             | 940             | 152              | 23,400                     | 電気通信サービス                    |
| BARCLAYS PLC   |                  | 1,030           | 1,524           | 289              | 44,303                     | 銀行                          |
| INTERTEK GROUP PLC   |                  | 11              | 14              | 74               | 11,417                     | 商業・専門サービス                   |
| BURBERRY GROUP PLC   |                  | 23              | 38              | 77               | 11,796                     | 耐久消費財・アパレル                  |
| NEXT PLC   |                  | 9               | 14              | 119              | 18,331                     | 小売                          |
| KINGFISHER PLC   |                  | 187             | 245             | 81               | 12,413                     | 小売                          |
| ADMIRAL GROUP PLC  |                  | 16              | 24              | 72               | 11,067                     | 保険                          |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  |                  | 214             | 346             | 580              | 88,769                     | エネルギー                       |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  |                  | 220             | 358             | 602              | 92,144                     | エネルギー                       |
| BUNZL PLC  |                  | 24              | 27              | 75               | 11,592                     | 資本財                         |

| 銘柄                                | 期首(前期末) | 当期末   |       |         |                        | 業種等    |  |
|-----------------------------------|---------|-------|-------|---------|------------------------|--------|--|
|                                   |         | 株数    | 株数    | 評価額     |                        |        |  |
|                                   |         |       |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額                 |        |  |
| (イギリス)                            |         | 百株    | 百株    | 千英ポンド   | 千円                     |        |  |
| RENTOKIL INITIAL PLC              | 142     | 221   | 134   | 20,637  | 商業・専門サービス              |        |  |
| London Stock Exchange Group PLC   | 19      | 33    | 235   | 36,074  | 各種金融                   |        |  |
| UNILEVER PLC                      | 66      | 233   | 911   | 139,486 | 家庭用品・パーソナル用品           |        |  |
| EXPERIAN PLC                      | 52      | 82    | 283   | 43,352  | 商業・専門サービス              |        |  |
| MONDI PLC                         | 32      | 36    | 67    | 10,262  | 素材                     |        |  |
| SEVERN TRENT PLC                  | 19      | 24    | 66    | 10,108  | 公益事業                   |        |  |
| Whitbread PLC                     | 20      | 34    | 114   | 17,565  | 消費者サービス                |        |  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC           | 21      | 35    | 54    | 8,274   | 各種金融                   |        |  |
| SMITHS GROUP PLC                  | 30      | 52    | 73    | 11,290  | 資本財                    |        |  |
| ANGLO AMERICAN PLC                | 80      | 133   | 363   | 55,636  | 素材                     |        |  |
| 3I GROUP PLC                      | 73      | 96    | 130   | 19,903  | 各種金融                   |        |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 43      | 72    | 445   | 68,153  | 家庭用品・パーソナル用品           |        |  |
| RELX PLC                          | 96      | 153   | 358   | 54,916  | 商業・専門サービス              |        |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC        | —       | 66    | 69    | 10,594  | 公益事業                   |        |  |
| OCADO GROUP PLC                   | —       | 74    | 129   | 19,769  | 食品・生活必需品小売り            |        |  |
| GLENCORE PLC                      | 659     | 1,038 | 369   | 56,476  | 素材                     |        |  |
| NATWEST GROUP PLC                 | 393     | 600   | 128   | 19,649  | 銀行                     |        |  |
| SAGE GROUP PLC/THE                | 83      | 83    | 61    | 9,436   | ソフトウェア・サービス            |        |  |
| WPP PLC                           | 114     | 133   | 146   | 22,396  | メディア・娯楽                |        |  |
| COMPASS GROUP PLC                 | 103     | 199   | 314   | 48,128  | 消費者サービス                |        |  |
| NATIONAL GRID PLC                 | 195     | 292   | 275   | 42,188  | 公益事業                   |        |  |
| ABRDN PLC                         | 192     | 192   | 49    | 7,565   | 各種金融                   |        |  |
| BHP GROUP PLC                     | 119     | 179   | 339   | 51,894  | 素材                     |        |  |
| VODAFONE GROUP PLC                | 1,534   | 2,616 | 292   | 44,736  | 電気通信サービス               |        |  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 16      | 27    | 143   | 21,910  | 消費者サービス                |        |  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           | 9       | 12    | 117   | 17,938  | 素材                     |        |  |
| FERGUSON PLC                      | 12      | 17    | 196   | 30,038  | 資本財                    |        |  |
| M&G PLC                           | 220     | 415   | 81    | 12,471  | 各種金融                   |        |  |
| RSA INSURANCE GROUP PLC           | 55      | —     | —     | —       | 保険                     |        |  |
| TESCO PLC                         | —       | 567   | 158   | 24,184  | 食品・生活必需品小売り            |        |  |
| INFORMA PLC                       | 151     | 218   | 116   | 17,763  | メディア・娯楽                |        |  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | —       | 623   | 103   | 15,766  | 資本財                    |        |  |
| AUTO TRADER GROUP PLC             | —       | 97    | 58    | 9,021   | メディア・娯楽                |        |  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      | 5       | 7     | 119   | 18,257  | 資本財                    |        |  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       | 81      | 266   | 73    | 11,270  | 保険                     |        |  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | 382     | —     | —     | —       | 資本財                    |        |  |
| JOHNSON MATTHEY PLC               | 13      | 19    | 52    | 7,981   | 素材                     |        |  |
| 小計                                | 株数      | ・     | 金額    | 16,458  | 2,517,718              |        |  |
|                                   | 銘柄      | 数     | <比率>  | 66      | 69                     | <4.1%> |  |
| (スイス)                             |         |       |       | 千スイスフラン |                        |        |  |
| SGS SA                            | 0.33    | 0.43  | 120   | 14,943  | 商業・専門サービス              |        |  |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG            | 0.24    | 0.4   | 86    | 10,690  | 食品・飲料・タバコ              |        |  |
| SWISSCOM AG-REG                   | 1       | 2     | 104   | 12,992  | 電気通信サービス               |        |  |
| Lindt & Spruengli AG              | 0.11    | 0.15  | 175   | 21,735  | 食品・飲料・タバコ              |        |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG       | —       | 0.01  | 117   | 14,539  | 食品・飲料・タバコ              |        |  |
| GIVAUDAN-REG                      | 0.52    | 0.79  | 347   | 43,040  | 素材                     |        |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG         | 7       | 12    | 495   | 61,399  | 保険                     |        |  |
| NOVARTIS AG-REG SHS               | 128     | 194   | 1,478 | 183,152 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末   |             |         |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|-------|-------------|---------|------------------------|-----|--|
|                              |         | 株数    | 株数          | 評価額     |                        |     |  |
|                              |         |       |             | 外貨建金額   | 邦貨換算金額                 |     |  |
| (スイス)                        |         | 百株    | 百株          | 千スイスフラン | 千円                     |     |  |
| ABB LTD                      | 95      | 162   | 518         | 64,212  | 資本財                    |     |  |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSS     | 41      | 66    | 2,433       | 301,430 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| ADECCO GROUP AG (REG)        | 13      | 21    | 99          | 12,364  | 商業・専門サービス              |     |  |
| HOLCIM LTD                   | 23      | 34    | 160         | 19,937  | 素材                     |     |  |
| CLARIANT AG-REG              | 21      | 31    | 60          | 7,532   | 素材                     |     |  |
| NESTLE SA-REGISTERED         | 171     | 258   | 3,176       | 393,461 | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| Baloise Holding AG           | 4       | 4     | 58          | 7,255   | 保険                     |     |  |
| TEMENOS GROUP AG-REG         | 5       | 10    | 147         | 18,236  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| SONOVA HOLDING AG            | 4       | 5     | 238         | 29,548  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 0.91    | 1     | 262         | 32,498  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG       | 146     | 262   | 245         | 30,412  | 各種金融                   |     |  |
| THE SWATCH GROUP AG-B        | 2       | 4     | 111         | 13,788  | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| LONZA GROUP AG-REG           | 4       | 7     | 560         | 69,414  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG        | 2       | 3     | 180         | 22,318  | 保険                     |     |  |
| SWISS PRIME SITE             | 6       | 6     | 61          | 7,605   | 不動産                    |     |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 1       | 2     | 357         | 44,278  | 各種金融                   |     |  |
| Schindler Holding AG         | 1       | 1     | 45          | 5,691   | 資本財                    |     |  |
| Schindler Holding AG         | 2       | 4     | 114         | 14,149  | 資本財                    |     |  |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   | 4       | 6     | 185         | 22,918  | 運輸                     |     |  |
| Logitech International SA    | 13      | 21    | 156         | 19,439  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| GEBERIT AG-REG               | 1       | 2     | 177         | 21,944  | 資本財                    |     |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 19      | 28    | 184         | 22,905  | 各種金融                   |     |  |
| SWISS RE AG                  | 16      | 25    | 230         | 28,607  | 保険                     |     |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG  | 27      | 51    | 633         | 78,465  | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| SIKA AG-REG                  | 8       | 13    | 427         | 52,896  | 素材                     |     |  |
| ALCON INC                    | 29      | 50    | 397         | 49,181  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| UBS GROUP AG                 | 210     | 312   | 522         | 64,742  | 各種金融                   |     |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 1,020 | 1,611       | 14,676  | 1,817,733              |     |  |
| 銘柄                           | 銘柄数<比率> | 34    | 35          | —       | <2.9%>                 |     |  |
| (スウェーデン)                     |         |       | 千スウェーデンクローナ |         |                        |     |  |
| SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A | 108     | 138   | 1,927       | 25,369  | 銀行                     |     |  |
| Swedbank AB                  | 56      | 68    | 1,298       | 17,093  | 銀行                     |     |  |
| SWEDISH MATCH AB             | 12      | —     | —           | —       | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| SECURITAS AB-B SHS           | 26      | 62    | 871         | 11,470  | 商業・専門サービス              |     |  |
| INVESTOR AB-B SHS            | 20      | —     | —           | —       | 各種金融                   |     |  |
| HENNES & MAURITZ AB-B        | 55      | 87    | 1,449       | 19,078  | 小売                     |     |  |
| ERICSSON LM-B SHS            | 174     | 271   | 2,607       | 34,311  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| TELIA COMPANY AB             | 189     | 259   | 891         | 11,737  | 電気通信サービス               |     |  |
| SKANSKA AB-B SHS             | 22      | 32    | 714         | 9,397   | 資本財                    |     |  |
| LUNDIN ENERGY AB             | 15      | 37    | 1,351       | 17,782  | エネルギー                  |     |  |
| ALFA LAVAL AB                | 20      | 34    | 1,296       | 17,067  | 資本財                    |     |  |
| Husqvarna AB                 | 49      | 79    | 991         | 13,054  | 資本財                    |     |  |
| SKF AB-B SHARES              | 24      | 38    | 797         | 10,499  | 資本財                    |     |  |
| VOLVO AB-B SHS               | 80      | 136   | 2,789       | 36,715  | 資本財                    |     |  |
| SANDVIK AB                   | 57      | 90    | 2,022       | 26,613  | 資本財                    |     |  |
| Industrivarden AB            | —       | 2     | 60          | 790     | 各種金融                   |     |  |
| Industrivarden AB            | 15      | 29    | 825         | 10,869  | 各種金融                   |     |  |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS   | —       | 63    | 858         | 11,299  | 素材                     |     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末)  | 当期末   |       |             |         | 業種等                    |  |
|------------------------------|----------|-------|-------|-------------|---------|------------------------|--|
|                              |          | 株数    | 株数    | 評価額         |         |                        |  |
|                              |          |       |       | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |                        |  |
| (スウェーデン)                     |          | 百株    | 百株    | 千スウェーデンクローナ | 千円      |                        |  |
| HEXAGON AB-B SHS             |          | 17    | —     | —           | —       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| TELE2 AB-B SHS               |          | 48    | 76    | 947         | 12,463  | 電気通信サービス               |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         |          | 30    | 51    | 2,863       | 37,686  | 資本財                    |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         |          | 32    | 42    | 2,009       | 26,448  | 資本財                    |  |
| EPIROC AB-A                  |          | 32    | —     | —           | —       | 資本財                    |  |
| EPIROC AB-B                  |          | 34    | —     | —           | —       | 資本財                    |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          |          | 33    | 55    | 1,579       | 20,785  | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| EQT AB                       |          | —     | 39    | 1,945       | 25,597  | 各種金融                   |  |
| BOLIDEN AB                   |          | 27    | —     | —           | —       | 素材                     |  |
| EVOLUTION AB                 |          | 10    | 19    | 2,730       | 35,933  | 消費者サービス                |  |
| EPIROC AB-A                  |          | —     | 67    | 1,509       | 19,858  | 資本財                    |  |
| EPIROC AB-B                  |          | —     | 39    | 755         | 9,944   | 資本財                    |  |
| INVESTOR AB-B SHS            |          | —     | 135   | 2,795       | 36,785  | 各種金融                   |  |
| BOLIDEN AB                   |          | —     | 32    | 963         | 12,677  | 素材                     |  |
| KINNEVIK AB-B                |          | 21    | —     | —           | —       | 各種金融                   |  |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     |          | —     | 180   | 2,426       | 31,928  | 資本財                    |  |
| KINNEVIK AB-B                |          | —     | 33    | 1,172       | 15,434  | 各種金融                   |  |
| HEXAGON AB-B SHS             |          | —     | 164   | 2,348       | 30,900  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| SWEDISH MATCH AB             |          | —     | 169   | 1,144       | 15,063  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |          | 97    | 136   | 1,375       | 18,098  | 銀行                     |  |
| ASSA ABLOY AB-B              |          | 48    | 80    | 2,082       | 27,402  | 資本財                    |  |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     |          | 29    | —     | —           | —       | 資本財                    |  |
| NORDEA BANK ABP              |          | 157   | 253   | 2,745       | 36,127  | 銀行                     |  |
| 小計                           | 株数・金額    | 1,552 | 3,011 | 52,149      | 686,287 |                        |  |
|                              | 銘柄数 <比率> | 30    | 33    | —           | <1.1%>  |                        |  |
| (ノルウェー)                      |          |       |       | 千ノルウェークローネ  |         |                        |  |
| TELENOR ASA                  |          | 51    | 51    | 703         | 9,329   | 電気通信サービス               |  |
| EQUINOR ASA                  |          | 62    | 80    | 1,819       | 24,139  | エネルギー                  |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA       |          | 9     | 9     | 443         | 5,883   | 素材                     |  |
| MOWI ASA                     |          | 30    | 49    | 1,177       | 15,619  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| NORSK HYDRO ASA              |          | 149   | 202   | 1,228       | 16,295  | 素材                     |  |
| ORKLA ASA                    |          | 56    | 56    | 480         | 6,379   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    |          | 15    | 34    | 734         | 9,746   | 保険                     |  |
| DNB BANK ASA                 |          | —     | 78    | 1,678       | 22,275  | 銀行                     |  |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          |          | 16    | 20    | 771         | 10,238  | メディア・娯楽                |  |
| 小計                           | 株数・金額    | 392   | 582   | 9,036       | 119,908 |                        |  |
|                              | 銘柄数 <比率> | 8     | 9     | —           | <0.2%>  |                        |  |
| (デンマーク)                      |          |       |       | 千デンマーククローネ  |         |                        |  |
| CARLSBERG AS-B               |          | 7     | 9     | 1,012       | 17,801  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       |          | 0.48  | 0.61  | 1,227       | 21,599  | 運輸                     |  |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A       |          | 0.2   | 0.32  | 612         | 10,779  | 運輸                     |  |
| DANSKE BANK A/S              |          | 48    | 57    | 630         | 11,086  | 銀行                     |  |
| GENMAB A/S                   |          | 4     | 7     | 2,225       | 39,140  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      |          | 12    | —     | —           | —       | 資本財                    |  |
| H LUNDBECK A/S               |          | 12    | —     | —           | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| DSV A/S                      |          | 13    | 21    | 3,377       | 59,406  | 運輸                     |  |
| PANDORA A/S                  |          | 7     | 8     | 813         | 14,305  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S |          | 7     | 14    | 773         | 13,598  | 素材                     |  |

| 銘柄                             | 期首(前期末)  | 当期末 |        |            |                        | 業種等 |  |
|--------------------------------|----------|-----|--------|------------|------------------------|-----|--|
|                                |          | 株数  | 株数     | 評価額        |                        |     |  |
|                                |          |     |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額                 |     |  |
| (デンマーク)                        |          | 百株  | 百株     | 千デンマーククローネ | 千円                     |     |  |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES         | 13       | 18  | 905    | 15,931     | 素材                     |     |  |
| COLOPLAST-B                    | 7        | 10  | 1,189  | 20,916     | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| NOVO NORDISK A/S-B             | 99       | 151 | 11,150 | 196,137    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S        | —        | 109 | 2,449  | 43,085     | 資本財                    |     |  |
| TRYG A/S                       | —        | 36  | 563    | 9,903      | 保険                     |     |  |
| ORSTED A/S                     | 12       | 22  | 1,969  | 34,634     | 公益事業                   |     |  |
| DEMANTE A/S                    | 11       | 22  | 738    | 12,983     | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| 小計                             | 株数・金額    | 259 | 491    | 29,636     | 521,309                |     |  |
|                                | 銘柄数 <比率> | 15  | 15     | <0.8%>     |                        |     |  |
| (オーストラリア)                      |          |     |        | 千豪ドル       |                        |     |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD         | —        | 28  | 204    | 17,003     | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LTD  | 155      | 226 | 632    | 52,613     | 銀行                     |     |  |
| WESTPAC BANKING CORPORATION    | 203      | 307 | 691    | 57,562     | 銀行                     |     |  |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD     | 115      | 175 | 255    | 21,292     | 素材                     |     |  |
| TELSTRA CORP LTD               | 286      | 356 | 139    | 11,620     | 電気通信サービス               |     |  |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED       | 51       | —   | —      | —          | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE      | 15       | 17  | 161    | 13,401     | 各種金融                   |     |  |
| BHP GROUP LIMITED              | 168      | 263 | 967    | 80,533     | 素材                     |     |  |
| COMPUTERSHARE LIMITED          | 47       | 100 | 191    | 15,899     | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| CSL LIMITED                    | 27       | 42  | 1,349  | 112,324    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| TRANSURBAN GROUP               | 175      | 309 | 422    | 35,189     | 運輸                     |     |  |
| COCHLEAR LIMITED               | 6        | 8   | 185    | 15,427     | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ORIGIN ENERGY LIMITED          | 134      | 366 | 183    | 15,231     | 公益事業                   |     |  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 100      | 157 | 1,713  | 142,619    | 銀行                     |     |  |
| RIO TINTO LIMITED              | 20       | 33  | 298    | 24,877     | 素材                     |     |  |
| APA GROUP                      | —        | 190 | 165    | 13,790     | 公益事業                   |     |  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         | —        | 73  | 348    | 28,968     | 消費者サービス                |     |  |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP      | 131      | 225 | 103    | 8,607      | 保険                     |     |  |
| ORICA LTD                      | 31       | 86  | 132    | 11,013     | 素材                     |     |  |
| LENDLEASE GROUP                | 51       | 128 | 140    | 11,651     | 不動産                    |     |  |
| BLUESCOPE STEEL LTD            | —        | 53  | 112    | 9,367      | 素材                     |     |  |
| SUNCORP GROUP LTD              | 103      | 109 | 123    | 10,263     | 保険                     |     |  |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 188      | 280 | 811    | 67,543     | 銀行                     |     |  |
| NEWCREST MINING LIMITED        | 49       | 73  | 182    | 15,219     | 素材                     |     |  |
| AMP LIMITED                    | 365      | —   | —      | —          | 各種金融                   |     |  |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED    | 105      | 151 | 177    | 14,751     | 保険                     |     |  |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD    | 62       | 186 | 188    | 15,679     | 素材                     |     |  |
| SANTOS LTD                     | 151      | 189 | 131    | 10,954     | エネルギー                  |     |  |
| SONIC HEALTHCARE LTD           | 40       | 46  | 184    | 15,380     | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED       | 284      | 394 | 203    | 16,928     | 消費者サービス                |     |  |
| WESFARMERS LIMITED             | 59       | 89  | 536    | 44,641     | 小売                     |     |  |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD         | 58       | 81  | 186    | 15,517     | エネルギー                  |     |  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD           | 70       | 104 | 410    | 34,149     | 食品・生活必需品小売             |     |  |
| SEEK LTD                       | 41       | 60  | 207    | 17,276     | メディア・娯楽                |     |  |
| BRAMBLES LTD                   | 107      | 107 | 111    | 9,286      | 商業・専門サービス              |     |  |
| MACQUARIE GROUP LTD            | 20       | 31  | 636    | 52,971     | 各種金融                   |     |  |
| EVOLUTION MINING LTD           | 163      | 348 | 137    | 11,409     | 素材                     |     |  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI    | —        | 42  | 228    | 19,021     | 素材                     |     |  |

| 銘柄                                   | 期首(前期末) | 当期末   |             |         |              | 業種等 |  |
|--------------------------------------|---------|-------|-------------|---------|--------------|-----|--|
|                                      |         | 株数    | 株数          | 評価額     |              |     |  |
|                                      |         |       |             | 外貨建金額   | 邦貨換算金額       |     |  |
| (オーストラリア)                            |         |       |             |         |              |     |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD            | 百株      | 百株    | 千豪ドル        | 千円      |              |     |  |
| SYDNEY AIRPORT                       | 56      | 132   | 153         | 12,748  | 食品・飲料・タバコ    |     |  |
| XERO LTD                             | 100     | —     | —           | —       | 運輸           |     |  |
| AFTERPAY LTD                         | —       | 18    | 268         | 22,376  | ソフトウェア・サービス  |     |  |
| AMPOL LTD                            | 17      | 27    | 329         | 27,448  | ソフトウェア・サービス  |     |  |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA        | 18      | 48    | 150         | 12,487  | エネルギー        |     |  |
| AGL ENERGY LTD                       | —       | 237   | 167         | 13,976  | 食品・生活必需品小売り  |     |  |
| SOUTH32 LTD                          | 30      | —     | —           | —       | 公益事業         |     |  |
| COLES GROUP LTD                      | 469     | 597   | 211         | 17,600  | 素材           |     |  |
|                                      | 83      | 111   | 196         | 16,356  | 食品・生活必需品小売り  |     |  |
| 小計                                   | 株数・金額   | 4,371 | 6,620       | 14,337  | 1,192,984    |     |  |
| 銘柄数 <比率>                             |         | 40    | 43          | —       | <1.9%>       |     |  |
| (ニュージーランド)                           |         |       | 千ニュージーランドドル |         |              |     |  |
| RYMAN HEALTHCARE LTD                 | 46      | 61    | 90          | 7,310   | ヘルスケア機器・サービス |     |  |
| A2 MILK CO LTD                       | 53      | 184   | 120         | 9,711   | 食品・飲料・タバコ    |     |  |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C         | 38      | 62    | 201         | 16,177  | ヘルスケア機器・サービス |     |  |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                | 112     | 346   | 157         | 12,638  | 電気通信サービス     |     |  |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD            | 84      | 229   | 187         | 15,095  | 運輸           |     |  |
| MERIDIAN ENERGY LTD                  | 114     | 212   | 104         | 8,401   | 公益事業         |     |  |
| 小計                                   | 株数・金額   | 451   | 1,096       | 862     | 69,336       |     |  |
| 銘柄数 <比率>                             |         | 6     | 6           | —       | <0.1%>       |     |  |
| (香港)                                 |         |       | 千香港ドル       |         |              |     |  |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY               | 40      | —     | —           | —       | 半導体・半導体製造装置  |     |  |
| BANK OF EAST ASIA                    | 174     | —     | —           | —       | 銀行           |     |  |
| CLP HOLDINGS LIMITED                 | 105     | 105   | 798         | 11,570  | 公益事業         |     |  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR          | 78      | 122   | 5,673       | 82,201  | 各種金融         |     |  |
| MTR CORPORATION                      | 125     | 160   | 690         | 10,003  | 運輸           |     |  |
| HANG SENG BANK                       | 44      | 56    | 815         | 11,822  | 銀行           |     |  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT           | 154     | 314   | 1,047       | 15,175  | 不動産          |     |  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED        | 90      | 105   | 497         | 7,211   | 公益事業         |     |  |
| HONG KONG & CHINA GAS                | 773     | 985   | 1,171       | 16,971  | 公益事業         |     |  |
| Galaxy Entertainment Group Limited   | 180     | 330   | 1,453       | 21,063  | 消費者サービス      |     |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD           | 270     | 320   | 780         | 11,313  | 銀行           |     |  |
| SINO LAND CO                         | 358     | 698   | 695         | 10,073  | 不動産          |     |  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES              | 65      | 120   | 1,186       | 17,188  | 不動産          |     |  |
| SWIRE PACIFIC LTD A                  | 70      | 125   | 616         | 8,938   | 不動産          |     |  |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO             | 100     | 160   | 2,579       | 37,372  | 資本財          |     |  |
| AIA GROUP LTD                        | 718     | 1,146 | 9,809       | 142,143 | 保険           |     |  |
| HKT Trust / HKT Ltd                  | 370     | 780   | 834         | 12,093  | 電気通信サービス     |     |  |
| Sands China Ltd                      | 240     | 576   | 1,042       | 15,106  | 消費者サービス      |     |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD                 | 126     | 206   | 425         | 6,163   | 不動産          |     |  |
| WH Group Limited                     | 655     | 1,660 | 884         | 12,820  | 食品・飲料・タバコ    |     |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD            | 143     | 228   | 1,203       | 17,431  | 資本財          |     |  |
| CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI) | 70      | 115   | 537         | 7,790   | 公益事業         |     |  |
| CK ASSET HOLDINGS LIMITED            | 178     | 193   | 927         | 13,443  | 不動産          |     |  |
| 小計                                   | 株数・金額   | 5,127 | 8,505       | 33,671  | 487,900      |     |  |
| 銘柄数 <比率>                             |         | 23    | 21          | —       | <0.8%>       |     |  |
| (シンガポール)                             |         |       | 千シンガポールドル   |         |              |     |  |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING           | 194     | 294   | 112         | 9,385   | 資本財          |     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末)           |           | 当期末               |              |             | 業種等 |  |
|------------------------------|-------------------|-----------|-------------------|--------------|-------------|-----|--|
|                              | 株数                | 株数        | 評価額               |              | 邦貨換算金額      |     |  |
|                              |                   |           | 外貨建金額             | 邦貨換算金額       |             |     |  |
| (シンガポール)                     |                   |           |                   |              |             |     |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 百株<br>89          | 百株<br>168 | 千シンガポールドル<br>542  | 千円<br>45,467 | 銀行          |     |  |
| CITY DEVELOPMENTS            | 86                | 169       | 122               | 10,252       | 不動産         |     |  |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 215               | —         | —                 | —            | 運輸          |     |  |
| UNITED OVERSEAS BANK         | 56                | 89        | 248               | 20,805       | 銀行          |     |  |
| UNITED OVERSEAS LAND LTD     | 71                | 119       | 84                | 7,099        | 不動産         |     |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | —                 | 1,081     | 277               | 23,278       | 電気通信サービス    |     |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 579               | —         | —                 | —            | 電気通信サービス    |     |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 130               | 226       | 268               | 22,496       | 銀行          |     |  |
| KEPPEL CORP LTD              | 159               | 306       | 162               | 13,614       | 資本財         |     |  |
| GENTING SINGAPORE LTD        | 856               | 1,792     | 146               | 12,237       | 消費者サービス     |     |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数 <比率> | 2,435     | 4,244             | 1,964        | 164,637     |     |  |
| (イスラエル)                      |                   |           |                   |              |             |     |  |
| BANK HAPOALIM BM             | 86                | 117       | 千イスラエルシェケル<br>361 | 13,125       | 銀行          |     |  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 102               | 102       | 311               | 11,301       | 銀行          |     |  |
| ICL GROUP LTD                | 35                | 139       | 384               | 13,955       | 素材          |     |  |
| NICE LTD                     | 4                 | 7         | 648               | 23,570       | ソフトウェア・サービス |     |  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 18                | 30        | 339               | 12,332       | 銀行          |     |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数 <比率> | 246       | 396               | 2,044        | 74,284      |     |  |
| 合計                           | 株数・金額<br>銘柄数 <比率> | 62,448    | 100,767           | —            | 58,931,508  |     |  |
|                              |                   | 978       | 1,014             | —            | <95.3%>     |     |  |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

## 外国投資信託証券

| 銘柄                                  | 期首(前期末)     |         | 当期末         |              |        | 比率 |  |
|-------------------------------------|-------------|---------|-------------|--------------|--------|----|--|
|                                     | 口数          | 口数      | 評価額         |              | 邦貨換算金額 |    |  |
|                                     |             |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額       |        |    |  |
| (アメリカ)                              |             |         |             |              |        | %  |  |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 千口<br>0.757 | 千口<br>1 | 千米ドル<br>264 | 千円<br>29,802 | 0.0    |    |  |
| AMERICAN TOWER CORP                 | 2           | 4       | 1,177       | 132,843      | 0.2    |    |  |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC           | 0.607       | 1       | 255         | 28,781       | 0.0    |    |  |
| BOSTON PROPERTIES INC               | 0.824       | 1       | 188         | 21,232       | 0.0    |    |  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST               | 0.66        | 0.864   | 140         | 15,889       | 0.0    |    |  |
| CROWN CASTLE INTL CORP              | 2           | 4       | 737         | 83,194       | 0.1    |    |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC            | 1           | 2       | 446         | 50,387       | 0.1    |    |  |
| DUKE REALTY CORP                    | 2           | 3       | 192         | 21,686       | 0.0    |    |  |
| EQUINIX INC                         | 0.535       | 0.887   | 707         | 79,864       | 0.1    |    |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC     | 1           | 1       | 115         | 13,041       | 0.0    |    |  |
| EQUITY RESIDENTIAL                  | 1           | 2       | 254         | 28,683       | 0.0    |    |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC            | 0.381       | 0.568   | 193         | 21,836       | 0.0    |    |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC             | 0.93        | 1       | 242         | 27,334       | 0.0    |    |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST           | 0.502       | —       | —           | —            | —      |    |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC           | 3           | 5       | 179         | 20,202       | 0.0    |    |  |

| 銘柄                                    | 期首(前期末) | 当期末   |       |        |           | 比率  |
|---------------------------------------|---------|-------|-------|--------|-----------|-----|
|                                       |         | 口数    | 口数    | 評価額    | 外貨建金額     |     |
|                                       |         |       |       | 邦貨換算金額 |           |     |
| (アメリカ)                                |         | 千口    | 千口    | 千米ドル   | 千円        | %   |
| HOST HOTELS & RESORTS INC             | 5       | 5     | 10    | 194    | 21,905    | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC                  | —       | —     | 5     | 237    | 26,827    | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC                     | 2       | —     | —     | —      | —         | —   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC          | 4       | 4     | 8     | 175    | 19,762    | 0.0 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 0.834   | 0.834 | 0.969 | 196    | 22,151    | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC        | 1       | 1     | —     | —      | —         | —   |
| PROLOGIS INC                          | 4       | 4     | 6     | 1,024  | 115,619   | 0.2 |
| PUBLIC STORAGE                        | 0.842   | 0.842 | 1     | 418    | 47,206    | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP                    | 1       | 1     | 3     | 236    | 26,644    | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP                  | 1       | 1     | 2     | 154    | 17,417    | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP               | 0.686   | 0.686 | 1     | 364    | 41,175    | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC              | 1       | 1     | 3     | 554    | 62,549    | 0.1 |
| SUN COMMUNITIES INC                   | 0.761   | 0.761 | 1     | 230    | 25,999    | 0.0 |
| UDR INC                               | 2       | 2     | 3     | 177    | 19,986    | 0.0 |
| VENTAS INC                            | 2       | 2     | 4     | 228    | 25,758    | 0.0 |
| VICI PROPERTIES INC                   | —       | —     | 8     | 235    | 26,578    | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST                  | 1       | 1     | 3     | 142    | 16,075    | 0.0 |
| WP CAREY INC                          | 1       | 1     | 1     | 143    | 16,219    | 0.0 |
| WELLTOWER INC                         | 2       | 2     | 4     | 370    | 41,767    | 0.1 |
| WEYERHAEUSER CO                       | 4       | 4     | 6     | 260    | 29,355    | 0.0 |
| 小計                                    | 口数・金額   | 61    | 108   | 10,435 | 1,177,782 |     |
|                                       | 銘柄数<比率> | 33    | 32    | —      | <1.9%>    |     |
| (カナダ)                                 |         |       |       | 千カナダドル |           |     |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 2       | 2     | 4     | 100    | 9,147     | 0.0 |
| 小計                                    | 口数・金額   | 2     | 4     | 100    | 9,147     |     |
|                                       | 銘柄数<比率> | 1     | 1     | —      | <0.0%>    |     |
| (ヨーロ…フランス)                            |         |       |       | 千ユーロ   |           |     |
| KLEPIERRE                             | 1       | 1     | 3     | 86     | 11,375    | 0.0 |
| GECINA SA                             | 0.267   | 0.267 | 0.267 | 32     | 4,282     | 0.0 |
| COVIVIO                               | 0.366   | 0.366 | 0.894 | 67     | 8,839     | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD             | 1       | 1     | 1     | 111    | 14,579    | 0.0 |
| ユ一口計                                  | 口数・金額   | 3     | 6     | 298    | 39,077    |     |
|                                       | 銘柄数<比率> | 4     | 4     | —      | <0.1%>    |     |
| (イギリス)                                |         |       |       | 千英ポンド  |           |     |
| BRITISH LAND CO PLC                   | 6       | 6     | 16    | 82     | 12,590    | 0.0 |
| SEGRO PLC                             | 7       | 7     | 9     | 124    | 19,029    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC             | 4       | 4     | 10    | 74     | 11,462    | 0.0 |
| 小計                                    | 口数・金額   | 19    | 36    | 281    | 43,082    |     |
|                                       | 銘柄数<比率> | 3     | 3     | —      | <0.1%>    |     |
| (オーストラリア)                             |         |       |       | 千豪ドル   |           |     |
| MIRVAC GROUP                          | 28      | 28    | 39    | 112    | 9,383     | 0.0 |
| GPT GROUP                             | 14      | 14    | 17    | 92     | 7,692     | 0.0 |
| STOCKLAND                             | 19      | 19    | 24    | 110    | 9,182     | 0.0 |
| DEXUS/AU                              | 7       | 7     | 7     | 80     | 6,728     | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                         | 10      | 10    | 15    | 367    | 30,610    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                         | 35      | 35    | 50    | 159    | 13,264    | 0.0 |
| 小計                                    | 口数・金額   | 116   | 155   | 923    | 76,863    |     |
|                                       | 銘柄数<比率> | 6     | 6     | —      | <0.1%>    |     |

| 銘柄   | 期首(前期末)          | 当期末      |          |                  |                          |
|--|------------------|----------|----------|------------------|--------------------------|
|  |                  | 口数       | 口数       | 評価額              | 比率                       |
|  |                  |          |          | 外貨建金額            |                          |
| (香港)<br>LINK REIT                                  |                  | 千口<br>15 | 千口<br>18 | 千香港ドル<br>1,306   | 千円<br>18,932<br>%<br>0.0 |
| 小計   | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 15       | 18       | 1,306            | 18,932                   |
| (シンガポール)<br>CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST |                  | 47       | 87       | 千シンガポールドル<br>188 | 15,835<br>0.0            |
| 小計   | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 47       | 87       | 188              | 15,835                   |
| 合計   | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 266      | 418      | —                | 1,380,720                |
|  |                  | 49       | 48       | —                | <2.2%>                   |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

### 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別  | 当期末          |     |          |
|--|--------------|-----|----------|
|  | 買建額          | 売建額 |          |
| 外<br>国<br>株式先物取引                             | 百万円<br>1,161 | —   | 百万円<br>— |
| S&P 500 EMIN<br>DJ EU STX 50<br>FTSE 100 IDX | 232          | —   | —        |
|  | 144          | —   | —        |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

## ○投資信託財産の構成

(2021年11月10日現在)

| 項目           | 当期末              |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評価額              | 比率        |
| 株式           | 千円<br>58,931,509 | %<br>95.2 |
| 投資証券         | 1,380,720        | 2.2       |
| コール・ローン等、その他 | 1,580,234        | 2.6       |
| 投資信託財産総額     | 61,892,463       | 100.0     |

(注) 当期末における外貨建純資産 (61,688,427千円) の投資信託財産総額 (61,892,463千円) に対する比率は99.7%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは  
1米ドル=112.86円、1カナダドル=90.70円、1ユーロ=130.83円、1英ポンド=152.97円、1スイスフラン=123.85円、1スウェーデンクローナ=13.16円、1ノルウェークローネ=13.27円、1デンマーククローネ=17.59円、1豪ドル=83.21円、1ニュージーランドドル=80.42円、1香港ドル=14.49円、1シンガポールドル=83.79円、1イスラエルシェケル=36.33円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年11月10日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 円               |
| コール・ローン等        | 61,991,619,132  |
| 株式(評価額)         | 741,899,903     |
| 投資証券(評価額)       | 58,931,509,195  |
| 未収入金            | 1,380,720,842   |
| 未収配当金           | 190,767,431     |
| 差入委託証拠金         | 41,246,077      |
| (B) 負債          | 705,475,684     |
| 未払金             | 162,195,320     |
| 未払解約金           | 115,784,332     |
| 未払利息            | 46,410,643      |
|                 | 345             |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 61,829,423,812  |
| 元本              | 15,096,651,804  |
| 次期繰越損益金         | 46,732,772,008  |
| (D) 受益権総口数      | 15,096,651,804口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 40,956円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は9,631,640,362円、期中追加設定元本額は12,994,905,631円、期中一部解約元本額は7,529,894,189円です。

<元本の内訳>

|   |                |
|---|----------------|
| 東京海上セレクション・外国株式インデックス2 <sub>く</sub> 適格機関投資家限定 | 7,123,272,084円 |
| 東京海上セレクション・外國株式インデックス                         | 6,373,597,588円 |
| 東京海上・世界インデックス・バランス6.0 <sub>く</sub> 適格機関投資家限定  | 1,063,230,006円 |
| 先進国株式インデックス (適格機関投資家専用)                       | 176,043,772円   |
| 東京海上・世界インデックス・バランス4.0 <sub>く</sub> 適格機関投資家限定  | 132,487,759円   |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)                     | 74,127,394円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035                        | 47,432,147円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065                        | 35,586,164円    |
| TMA外國株式インデックスVA <sub>く</sub> 適格機関投資家限定        | 31,864,387円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045                        | 23,134,784円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055                        | 15,875,719円    |

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

## ○損益の状況

(2020年11月11日～2021年11月10日)

| 項目                 | 当期               |
|--------------------|------------------|
| (A) 配当等収益          | 円                |
| 受取配当金              | 707,048,816      |
| 受取利息               | 693,718,246      |
| その他収益金             | △ 842,220        |
| 支払利息               | 14,259,604       |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 86,814         |
| 売買益                | 13,656,717,457   |
| 売買損                | 14,339,706,179   |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 682,988,722    |
| 取引益                | 340,277,892      |
| 取引損                | 370,436,926      |
| (D) 保管費用等          | △ 30,159,034     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 19,803,441     |
| (F) 前期繰越損益金        | 14,684,240,724   |
| (G) 追加信託差損益金       | 18,111,489,354   |
| (H) 解約差損益金         | 34,419,665,665   |
| (I) 計(E+F+G+H)     | △ 20,482,623,735 |
| (J) 次期繰越損益金(I)     | 46,732,772,008   |
|                    | 46,732,772,008   |

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換算によるものを含みます。

(注) (G)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (H)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約額を差し引いた差額分です。

## TMA外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第16期（決算日 2021年11月10日）

(計算期間 2020年11月11日～2021年11月10日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。  
また、一印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

## ○最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額  | ペ ン チ マ ー ク |         | 債組入比率  | 純 総 資 産 額         |
|------------------|----------|-------------|---------|--------|-------------------|
|                  |          | 期 謄         | 中 落 率   |        |                   |
| 12期(2017年11月10日) | 円 15,662 | % 11.5      | 269.321 | % 10.8 | % 98.6 百万円 46,126 |
| 13期(2018年11月12日) | 15,274   | △ 2.5       | 262.755 | △ 2.4  | 98.9 4,169        |
| 14期(2019年11月11日) | 15,809   | 3.5         | 272.101 | 3.6    | 97.7 4,542        |
| 15期(2020年11月10日) | 16,671   | 5.5         | 287.164 | 5.5    | 98.8 6,878        |
| 16期(2021年11月10日) | 17,599   | 5.6         | 303.543 | 5.7    | 99.3 9,910        |

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日                | 基 準 価 額  | ペ ン チ マ ー ク |         | 債組入比率 | 券 率    |
|----------------------|----------|-------------|---------|-------|--------|
|                      |          | 騰 落         | 率 %     |       |        |
| (期 首)<br>2020年11月10日 | 円 16,671 | % —         | 287.164 | % —   | % 98.8 |
| 11月末                 | 16,734   | 0.4         | 288.333 | 0.4   | 98.0   |
| 12月末                 | 16,874   | 1.2         | 290.769 | 1.3   | 98.9   |
| 2021年1月末             | 16,851   | 1.1         | 290.443 | 1.1   | 98.3   |
| 2月末                  | 16,698   | 0.2         | 287.771 | 0.2   | 98.5   |
| 3月末                  | 17,066   | 2.4         | 294.185 | 2.4   | 98.7   |
| 4月末                  | 17,060   | 2.3         | 294.142 | 2.4   | 98.4   |
| 5月末                  | 17,288   | 3.7         | 297.961 | 3.8   | 98.8   |
| 6月末                  | 17,261   | 3.5         | 297.603 | 3.6   | 98.4   |
| 7月末                  | 17,378   | 4.2         | 299.643 | 4.3   | 99.0   |
| 8月末                  | 17,371   | 4.2         | 299.594 | 4.3   | 98.9   |
| 9月末                  | 17,257   | 3.5         | 297.537 | 3.6   | 98.7   |
| 10月末                 | 17,620   | 5.7         | 303.904 | 5.8   | 99.0   |
| (期 末)<br>2021年11月10日 | 17,599   | 5.6         | 303.543 | 5.7   | 99.3   |

(注) 謄落率は期首比です。

ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値を用いて計算しているため、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）を使用しています。  
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

## ○運用経過

(2020年11月11日～2021年11月10日)

### ■期中の基準価額等の推移

期 首：16,671円  
期 末：17,599円  
騰落率： 5.6%

### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・先進国を中心とした景気回復期待の高まりなどによる円安の進行
- ・保有する債券の利息収入

#### マイナス要因

- ・米国債をはじめとして世界的に国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

### ■投資環境

#### 【外国債券市場】

米国債利回りは上昇しました。期前半、バイデン米政権による大規模な財政支援策などを背景に、米国債利回りは上昇基調で推移しました。期半ば以降、新型コロナウイルス変異株の感染拡大などを受けて米国債利回りは低下基調となりましたが、期末にかけては今後予定されるFRB（米連邦準備制度理事会）によるテーパリング（量的緩和の縮小）の開始などを受けて再度上昇に転じ、前期末対比で上昇して期を終えました。

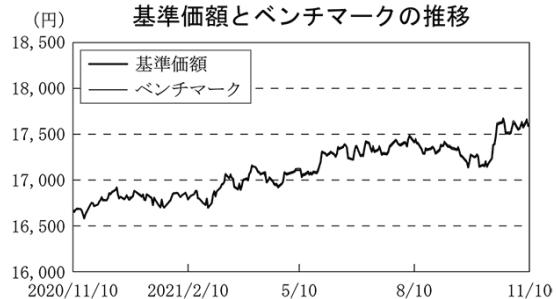
ドイツ国債利回りは上昇しました。新型コロナウイルスワクチン接種の進展やインフレ懸念などを背景に、ECB（欧洲中央銀行）による早期利上げ観測を織り込むかたちでドイツ国債利回りは上昇基調となりました。

#### 【為替市場】

当期、米ドル円相場は円安米ドル高、ユーロ円相場は円安ユーロ高となりました。

期初、米ドル円相場は、大規模な財政支援策の成立などを背景に円安米ドル高基調で推移しました。期半ば以降、米ドル円相場はレンジ内で推移しましたが、期末にかけて米国債利回りの上昇を受けて円安米ドル高が一段と進行しました。

ユーロ円相場は、新型コロナウイルスワクチン接種が進展するなか、欧州域内における景気回復期待の高まりなどから、円安ユーロ高が進行しました。



(注) ベンチマークは、期首(2020年11月10日)の値が基準価額と同一となるように指教化したものです。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

## ■ポートフォリオについて

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は5.6%上昇しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、基準価額の騰落率は+5.6%となり、ベンチマークの騰落率+5.7%にほぼ連動する値動きとなりました。

### (主な差異要因)

#### プラス要因

- ・特にありません

#### マイナス要因

- ・取引や保管などに係るコスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>(※)</sup>は、10月末現在、推定値で0.09%となっています。

※2021年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

## ○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年11月11日～2021年11月10日)

| 項目                            | 当期                   |                                  | 項目の概要   |
|-------------------------------|----------------------|----------------------------------|---|
|                               | 金額                   | 比率                               |   |
| (a) その他の費用<br>（保管費用）<br>（その他） | 円<br>3<br>(3)<br>(0) | %<br>0.016<br>(0.016)<br>(0.000) | (a) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>*その他は、信託事務等に要する諸費用 |
| 合計                            | 3                    | 0.016                            |   |
| 期中の平均基準価額は、17,121円です。         |                      |                                  |   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ○売買及び取引の状況

(2020年11月11日～2021年11月10日)

## 公社債

|        |         | 買付額                      | 売付額                |
|--------|---------|--------------------------|--------------------|
| 外<br>國 | アメリカ    | 国債証券<br>千米ドル<br>17,266   | 千米ドル<br>3,941      |
|        | カナダ     | 国債証券<br>千カナダドル<br>922    | 千カナダドル<br>403      |
|        | メキシコ    | 国債証券<br>千メキシコペソ<br>2,925 | 千メキシコペソ<br>709     |
|        | ユーロ     |                          | 千ユーロ               |
|        | ドイツ     | 国債証券<br>2,089            | 709                |
|        | イタリア    | 国債証券<br>2,218            | 407                |
|        | フランス    | 国債証券<br>2,256            | 207                |
|        | オランダ    | 国債証券<br>491              | 100                |
|        | スペイン    | 国債証券<br>1,217            | 106                |
|        | ベルギー    | 国債証券<br>452              | 104                |
|        | オーストリア  | 国債証券<br>442              | 100                |
|        | フィンランド  | 国債証券<br>108              | —                  |
|        | アイルランド  | 国債証券<br>227              | —                  |
|        | イギリス    | 千英ポンド<br>1,305           | 千英ポンド<br>352       |
|        | スウェーデン  | 千スウェーデンクローナ<br>805       | 千スウェーデンクローナ<br>310 |
|        | ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>711        | 千ノルウェークローネ<br>—    |
|        | デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>793        | 千デンマーククローネ<br>—    |
|        | ポーランド   | 千ポーランドズロチ<br>712         | 千ポーランドズロチ<br>305   |
|        | オーストラリア | 千豪ドル<br>405              | 千豪ドル<br>540        |
|        | シンガポール  | 千シンガポールドル<br>121         | 千シンガポールドル<br>—     |
|        | マレーシア   | 千マレーシアリンギット<br>521       | 千マレーシアリンギット<br>101 |
|        | イスラエル   | 千イスラエルシェケル<br>594        | 千イスラエルシェケル<br>105  |
|        | 中国      | 千オフショア元<br>1,011         | 千オフショア元<br>—       |

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年11月11日～2021年11月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2021年11月10日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区分      | 当期末                  |                      |                 |           |             |           |           |          |
|---------|----------------------|----------------------|-----------------|-----------|-------------|-----------|-----------|----------|
|         | 額面金額                 | 評価額                  |                 | 組入比率      | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 |           |          |
|         |                      | 外貨建金額                | 邦貨換算金額          |           |             | 5年以上      | 2年以上      | 2年未満     |
| アメリカ    | 千米ドル<br>39,050       | 千米ドル<br>40,568       | 千円<br>4,578,570 | %<br>46.2 | %<br>—      | %<br>21.6 | %<br>16.3 | %<br>8.4 |
| カナダ     | 千カナダドル<br>2,100      | 千カナダドル<br>2,140      | 千円<br>194,168   | 2.0       | —           | 1.0       | 0.5       | 0.5      |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>11,700    | 千メキシコペソ<br>12,133    | 千円<br>67,377    | 0.7       | —           | 0.4       | 0.3       | 0.0      |
| ユーロ     | 千ユーロ                 | 千ユーロ                 |                 |           |             |           |           |          |
| ドイツ     | 4,700                | 5,506                | 720,474         | 7.3       | —           | 4.7       | 1.8       | 0.8      |
| イタリア    | 6,000                | 6,892                | 901,777         | 9.1       | —           | 5.5       | 2.4       | 1.2      |
| フランス    | 6,500                | 7,603                | 994,806         | 10.0      | —           | 6.7       | 2.4       | 1.0      |
| オランダ    | 1,100                | 1,400                | 183,167         | 1.8       | —           | 1.3       | 0.4       | 0.1      |
| スペイン    | 3,800                | 4,459                | 583,461         | 5.9       | —           | 3.9       | 1.4       | 0.5      |
| ベルギー    | 1,400                | 1,743                | 228,163         | 2.3       | —           | 1.8       | 0.4       | 0.1      |
| オーストリア  | 900                  | 1,069                | 139,881         | 1.4       | —           | 1.0       | 0.3       | 0.1      |
| フィンランド  | 400                  | 443                  | 58,036          | 0.6       | —           | 0.4       | 0.2       | —        |
| アイルランド  | 600                  | 672                  | 87,942          | 0.9       | —           | 0.6       | 0.3       | —        |
| イギリス    | 千英ポンド<br>3,140       | 千英ポンド<br>4,070       | 622,684         | 6.3       | —           | 4.9       | 0.9       | 0.5      |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローナ<br>2,000 | 千スウェーデンクローナ<br>2,203 | 28,999          | 0.3       | —           | 0.2       | 0.1       | —        |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>1,800  | 千ノルウェークローネ<br>1,814  | 24,084          | 0.2       | —           | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>2,300  | 千デンマーククローネ<br>2,765  | 48,639          | 0.5       | —           | 0.4       | 0.1       | 0.0      |
| ポーランド   | 千ポーランドズロチ<br>1,800   | 千ポーランドズロチ<br>1,747   | 49,776          | 0.5       | —           | 0.2       | 0.2       | 0.1      |
| オーストラリア | 千豪ドル<br>2,000        | 千豪ドル<br>2,085        | 173,511         | 1.8       | —           | 1.1       | 0.5       | 0.1      |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>500     | 千シンガポールドル<br>544     | 45,582          | 0.5       | —           | 0.4       | 0.1       | —        |
| マレーシア   | 千マレーシアリンギット<br>1,700 | 千マレーシアリンギット<br>1,734 | 47,154          | 0.5       | —           | 0.3       | 0.1       | 0.1      |
| イスラエル   | 千イスラエルシェケル<br>1,100  | 千イスラエルシェケル<br>1,269  | 46,133          | 0.5       | —           | 0.3       | 0.2       | 0.0      |
| 中国      | 千オフショア元<br>1,000     | 千オフショア元<br>1,015     | 17,945          | 0.2       | —           | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| 合計      | —                    | —                    | 9,842,338       | 99.3      | —           | 56.7      | 29.0      | 13.6     |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄               | 当期末   |      |      |        |            |
|------------------|-------|------|------|--------|------------|
|                  | 利率    | 額面金額 | 評価額  | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |
|                  |       |      |      | 償還年月日  |            |
| (アメリカ)<br>国債証券   | %     | 千米ドル | 千米ドル | 千円     |            |
| T 0 1/2 02/28/26 | 0.5   | 100  | 97   | 11,049 | 2026/2/28  |
| T 0 1/2 03/15/23 | 0.5   | 100  | 100  | 11,321 | 2023/3/15  |
| T 0 1/2 04/30/27 | 0.5   | 100  | 96   | 10,902 | 2027/4/30  |
| T 0 1/2 05/31/27 | 0.5   | 200  | 192  | 21,774 | 2027/5/31  |
| T 0 1/2 06/30/27 | 0.5   | 100  | 96   | 10,879 | 2027/6/30  |
| T 0 1/2 08/31/27 | 0.5   | 200  | 192  | 21,697 | 2027/8/31  |
| T 0 1/2 10/31/27 | 0.5   | 100  | 95   | 10,824 | 2027/10/31 |
| T 0 1/4 03/15/24 | 0.25  | 200  | 198  | 22,414 | 2024/3/15  |
| T 0 1/4 04/15/23 | 0.25  | 100  | 99   | 11,285 | 2023/4/15  |
| T 0 1/4 05/15/24 | 0.25  | 100  | 99   | 11,187 | 2024/5/15  |
| T 0 1/4 05/31/25 | 0.25  | 200  | 195  | 22,094 | 2025/5/31  |
| T 0 1/4 06/15/23 | 0.25  | 300  | 299  | 33,818 | 2023/6/15  |
| T 0 1/4 06/15/24 | 0.25  | 200  | 198  | 22,357 | 2024/6/15  |
| T 0 1/4 06/30/25 | 0.25  | 300  | 293  | 33,109 | 2025/6/30  |
| T 0 1/4 07/31/25 | 0.25  | 100  | 97   | 11,021 | 2025/7/31  |
| T 0 1/4 08/31/25 | 0.25  | 300  | 292  | 33,015 | 2025/8/31  |
| T 0 1/4 09/30/23 | 0.25  | 200  | 199  | 22,512 | 2023/9/30  |
| T 0 1/4 09/30/25 | 0.25  | 200  | 194  | 21,999 | 2025/9/30  |
| T 0 1/4 10/31/25 | 0.25  | 400  | 389  | 43,923 | 2025/10/31 |
| T 0 1/8 02/15/24 | 0.125 | 300  | 297  | 33,569 | 2024/2/15  |
| T 0 1/8 04/30/23 | 0.125 | 200  | 199  | 22,517 | 2023/4/30  |
| T 0 1/8 05/15/23 | 0.125 | 200  | 199  | 22,510 | 2023/5/15  |
| T 0 1/8 05/31/23 | 0.125 | 100  | 99   | 11,252 | 2023/5/31  |
| T 0 1/8 06/30/23 | 0.125 | 200  | 199  | 22,499 | 2023/6/30  |
| T 0 1/8 07/15/23 | 0.125 | 200  | 199  | 22,487 | 2023/7/15  |
| T 0 1/8 07/31/23 | 0.125 | 200  | 199  | 22,481 | 2023/7/31  |
| T 0 1/8 08/15/23 | 0.125 | 100  | 99   | 11,237 | 2023/8/15  |
| T 0 1/8 08/31/23 | 0.125 | 300  | 298  | 33,706 | 2023/8/31  |
| T 0 1/8 09/15/23 | 0.125 | 500  | 497  | 56,152 | 2023/9/15  |
| T 0 1/8 09/30/22 | 0.125 | 400  | 399  | 45,135 | 2022/9/30  |
| T 0 1/8 10/15/23 | 0.125 | 700  | 696  | 78,563 | 2023/10/15 |
| T 0 1/8 12/15/23 | 0.125 | 700  | 694  | 78,421 | 2023/12/15 |
| T 0 1/8 12/31/22 | 0.125 | 100  | 99   | 11,275 | 2022/12/31 |
| T 0 3/4 03/31/26 | 0.75  | 300  | 296  | 33,479 | 2026/3/31  |
| T 0 3/4 04/30/26 | 0.75  | 200  | 197  | 22,304 | 2026/4/30  |
| T 0 3/4 05/31/26 | 0.75  | 100  | 98   | 11,145 | 2026/5/31  |
| T 0 3/4 08/31/26 | 0.75  | 300  | 295  | 33,364 | 2026/8/31  |
| T 0 3/8 01/31/26 | 0.375 | 500  | 487  | 55,006 | 2026/1/31  |
| T 0 3/8 04/15/24 | 0.375 | 100  | 99   | 11,230 | 2024/4/15  |
| T 0 3/8 04/30/25 | 0.375 | 100  | 98   | 11,110 | 2025/4/30  |
| T 0 3/8 07/15/24 | 0.375 | 300  | 297  | 33,626 | 2024/7/15  |
| T 0 3/8 07/31/27 | 0.375 | 200  | 191  | 21,592 | 2027/7/31  |
| T 0 3/8 08/15/24 | 0.375 | 400  | 397  | 44,805 | 2024/8/15  |

| 銘柄               | 当期末   |      |       |        |            |
|------------------|-------|------|-------|--------|------------|
|                  | 利率    | 額面金額 | 評価額   | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |
|                  |       |      | 償還年月日 |        |            |
| (アメリカ)<br>国債証券   | %     | 千米ドル | 千米ドル  | 千円     |            |
| T 0 3/8 09/15/24 | 0.375 | 100  | 99    | 11,192 | 2024/9/15  |
| T 0 3/8 09/30/27 | 0.375 | 400  | 381   | 43,036 | 2027/9/30  |
| T 0 3/8 12/31/25 | 0.375 | 300  | 292   | 33,043 | 2025/12/31 |
| T 0 5/8 05/15/30 | 0.625 | 400  | 375   | 42,410 | 2030/5/15  |
| T 0 5/8 07/31/26 | 0.625 | 300  | 294   | 33,183 | 2026/7/31  |
| T 0 5/8 08/15/30 | 0.625 | 300  | 281   | 31,731 | 2030/8/15  |
| T 0 5/8 10/15/24 | 0.625 | 200  | 199   | 22,533 | 2024/10/15 |
| T 0 5/8 11/30/27 | 0.625 | 400  | 386   | 43,565 | 2027/11/30 |
| T 0 5/8 12/31/27 | 0.625 | 100  | 96    | 10,882 | 2027/12/31 |
| T 0 7/8 06/30/26 | 0.875 | 200  | 198   | 22,397 | 2026/6/30  |
| T 0 7/8 11/15/30 | 0.875 | 200  | 191   | 21,594 | 2030/11/15 |
| T 1 07/31/28     | 1.0   | 300  | 294   | 33,215 | 2028/7/31  |
| T 1 1/2 01/31/27 | 1.5   | 200  | 204   | 23,048 | 2027/1/31  |
| T 1 1/2 02/15/30 | 1.5   | 500  | 505   | 57,091 | 2030/2/15  |
| T 1 1/2 02/28/23 | 1.5   | 100  | 101   | 11,476 | 2023/2/28  |
| T 1 1/2 03/31/23 | 1.5   | 100  | 101   | 11,478 | 2023/3/31  |
| T 1 1/2 09/15/22 | 1.5   | 400  | 404   | 45,662 | 2022/9/15  |
| T 1 1/2 09/30/24 | 1.5   | 100  | 102   | 11,552 | 2024/9/30  |
| T 1 1/2 10/31/24 | 1.5   | 300  | 307   | 34,662 | 2024/10/31 |
| T 1 1/2 11/30/24 | 1.5   | 200  | 204   | 23,109 | 2024/11/30 |
| T 1 1/4 04/30/28 | 1.25  | 300  | 299   | 33,823 | 2028/4/30  |
| T 1 1/4 05/15/50 | 1.25  | 200  | 173   | 19,621 | 2050/5/15  |
| T 1 1/4 05/31/28 | 1.25  | 300  | 299   | 33,802 | 2028/5/31  |
| T 1 1/4 06/30/28 | 1.25  | 200  | 199   | 22,520 | 2028/6/30  |
| T 1 1/4 07/31/23 | 1.25  | 100  | 101   | 11,457 | 2023/7/31  |
| T 1 1/4 08/15/31 | 1.25  | 400  | 393   | 44,385 | 2031/8/15  |
| T 1 1/4 08/31/24 | 1.25  | 300  | 304   | 34,416 | 2024/8/31  |
| T 1 1/4 09/30/28 | 1.25  | 200  | 199   | 22,475 | 2028/9/30  |
| T 1 1/8 02/15/31 | 1.125 | 400  | 390   | 44,055 | 2031/2/15  |
| T 1 1/8 02/28/25 | 1.125 | 300  | 303   | 34,242 | 2025/2/28  |
| T 1 1/8 02/29/28 | 1.125 | 300  | 298   | 33,643 | 2028/2/29  |
| T 1 1/8 05/15/40 | 1.125 | 200  | 177   | 20,037 | 2040/5/15  |
| T 1 1/8 08/15/40 | 1.125 | 100  | 88    | 9,992  | 2040/8/15  |
| T 1 1/8 08/31/28 | 1.125 | 300  | 296   | 33,471 | 2028/8/31  |
| T 1 3/4 01/31/23 | 1.75  | 300  | 305   | 34,486 | 2023/1/31  |
| T 1 3/4 05/15/23 | 1.75  | 500  | 510   | 57,653 | 2023/5/15  |
| T 1 3/4 07/31/24 | 1.75  | 300  | 309   | 34,894 | 2024/7/31  |
| T 1 3/4 08/15/41 | 1.75  | 200  | 196   | 22,195 | 2041/8/15  |
| T 1 3/4 09/30/22 | 1.75  | 200  | 202   | 22,891 | 2022/9/30  |
| T 1 3/4 11/15/29 | 1.75  | 300  | 309   | 34,957 | 2029/11/15 |
| T 1 3/4 12/31/24 | 1.75  | 600  | 619   | 69,866 | 2024/12/31 |
| T 1 3/4 12/31/26 | 1.75  | 300  | 310   | 35,008 | 2026/12/31 |
| T 1 3/8 01/31/25 | 1.375 | 200  | 203   | 23,019 | 2025/1/31  |

| 銘柄               | 当期末   |      |       |        |            |
|------------------|-------|------|-------|--------|------------|
|                  | 利率    | 額面金額 | 評価額   |        | 償還年月日      |
|                  |       |      | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |            |
| (アメリカ)<br>国債証券   | %     | 千米ドル | 千米ドル  | 千円     |            |
| T 1 3/8 02/15/23 | 1.375 | 200  | 202   | 22,898 | 2023/2/15  |
| T 1 3/8 08/15/50 | 1.375 | 200  | 179   | 20,239 | 2050/8/15  |
| T 1 3/8 10/15/22 | 1.375 | 100  | 101   | 11,412 | 2022/10/15 |
| T 1 3/8 11/15/40 | 1.375 | 100  | 92    | 10,420 | 2040/11/15 |
| T 1 5/8 02/15/26 | 1.625 | 600  | 615   | 69,501 | 2026/2/15  |
| T 1 5/8 05/15/26 | 1.625 | 200  | 205   | 23,177 | 2026/5/15  |
| T 1 5/8 05/15/31 | 1.625 | 400  | 407   | 46,016 | 2031/5/15  |
| T 1 5/8 08/15/22 | 1.625 | 100  | 101   | 11,416 | 2022/8/15  |
| T 1 5/8 08/15/29 | 1.625 | 300  | 306   | 34,621 | 2029/8/15  |
| T 1 5/8 09/30/26 | 1.625 | 200  | 205   | 23,195 | 2026/9/30  |
| T 1 5/8 11/15/22 | 1.625 | 100  | 101   | 11,452 | 2022/11/15 |
| T 1 5/8 11/30/26 | 1.625 | 300  | 308   | 34,789 | 2026/11/30 |
| T 1 5/8 12/15/22 | 1.625 | 100  | 101   | 11,463 | 2022/12/15 |
| T 1 7/8 02/15/41 | 1.875 | 300  | 301   | 33,991 | 2041/2/15  |
| T 1 7/8 07/31/26 | 1.875 | 100  | 103   | 11,722 | 2026/7/31  |
| T 2 02/15/23     | 2.0   | 300  | 306   | 34,621 | 2023/2/15  |
| T 2 02/15/25     | 2.0   | 200  | 207   | 23,457 | 2025/2/15  |
| T 2 02/15/50     | 2.0   | 500  | 519   | 58,588 | 2050/2/15  |
| T 2 06/30/24     | 2.0   | 100  | 103   | 11,695 | 2024/6/30  |
| T 2 08/15/25     | 2.0   | 800  | 832   | 94,008 | 2025/8/15  |
| T 2 08/15/51     | 2.0   | 200  | 208   | 23,495 | 2051/8/15  |
| T 2 1/2 01/31/24 | 2.5   | 200  | 208   | 23,566 | 2024/1/31  |
| T 2 1/2 02/15/46 | 2.5   | 100  | 112   | 12,743 | 2046/2/15  |
| T 2 1/2 05/15/24 | 2.5   | 500  | 523   | 59,119 | 2024/5/15  |
| T 2 1/2 05/15/46 | 2.5   | 100  | 113   | 12,754 | 2046/5/15  |
| T 2 1/2 08/15/23 | 2.5   | 300  | 311   | 35,105 | 2023/8/15  |
| T 2 1/4 05/15/41 | 2.25  | 300  | 320   | 36,115 | 2041/5/15  |
| T 2 1/4 08/15/27 | 2.25  | 100  | 105   | 11,956 | 2027/8/15  |
| T 2 1/4 08/15/46 | 2.25  | 200  | 216   | 24,396 | 2046/8/15  |
| T 2 1/4 08/15/49 | 2.25  | 200  | 218   | 24,666 | 2049/8/15  |
| T 2 1/4 11/15/24 | 2.25  | 800  | 836   | 94,456 | 2024/11/15 |
| T 2 1/4 11/15/27 | 2.25  | 400  | 424   | 47,875 | 2027/11/15 |
| T 2 1/8 05/15/25 | 2.125 | 300  | 313   | 35,365 | 2025/5/15  |
| T 2 11/15/26     | 2.0   | 100  | 104   | 11,794 | 2026/11/15 |
| T 2 11/30/22     | 2.0   | 400  | 407   | 46,013 | 2022/11/30 |
| T 2 3/4 02/15/28 | 2.75  | 600  | 654   | 73,910 | 2028/2/15  |
| T 2 3/4 07/31/23 | 2.75  | 100  | 104   | 11,748 | 2023/7/31  |
| T 2 3/4 08/15/42 | 2.75  | 100  | 115   | 13,044 | 2042/8/15  |
| T 2 3/4 08/15/47 | 2.75  | 100  | 118   | 13,420 | 2047/8/15  |
| T 2 3/4 11/15/23 | 2.75  | 600  | 627   | 70,837 | 2023/11/15 |
| T 2 3/4 11/15/42 | 2.75  | 200  | 231   | 26,109 | 2042/11/15 |
| T 2 3/8 05/15/27 | 2.375 | 100  | 106   | 12,023 | 2027/5/15  |
| T 2 3/8 05/15/29 | 2.375 | 100  | 107   | 12,123 | 2029/5/15  |
| T 2 3/8 05/15/51 | 2.375 | 300  | 338   | 38,174 | 2051/5/15  |

| 銘柄                 | 当期末   |        |        |           |            |
|--------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
|                    | 利率    | 額面金額   | 評価額    |           | 償還年月日      |
|                    |       |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)<br>国債証券     | %     | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円        |            |
| T 2 3/8 08/15/24   | 2.375 | 200    | 209    | 23,641    | 2024/8/15  |
| T 2 3/8 11/15/49   | 2.375 | 100    | 112    | 12,667    | 2049/11/15 |
| T 2 5/8 01/31/26   | 2.625 | 100    | 106    | 12,059    | 2026/1/31  |
| T 2 5/8 02/15/29   | 2.625 | 100    | 109    | 12,303    | 2029/2/15  |
| T 2 5/8 03/31/25   | 2.625 | 100    | 106    | 11,971    | 2025/3/31  |
| T 2 7/8 05/15/28   | 2.875 | 100    | 110    | 12,421    | 2028/5/15  |
| T 2 7/8 05/15/43   | 2.875 | 100    | 118    | 13,323    | 2043/5/15  |
| T 2 7/8 05/31/25   | 2.875 | 200    | 214    | 24,174    | 2025/5/31  |
| T 2 7/8 07/31/25   | 2.875 | 100    | 107    | 12,116    | 2025/7/31  |
| T 2 7/8 08/15/28   | 2.875 | 100    | 110    | 12,438    | 2028/8/15  |
| T 2 7/8 08/15/45   | 2.875 | 100    | 119    | 13,526    | 2045/8/15  |
| T 3 02/15/47       | 3.0   | 300    | 371    | 41,956    | 2047/2/15  |
| T 3 02/15/48       | 3.0   | 300    | 374    | 42,233    | 2048/2/15  |
| T 3 02/15/49       | 3.0   | 400    | 502    | 56,682    | 2049/2/15  |
| T 3 05/15/47       | 3.0   | 100    | 124    | 14,018    | 2047/5/15  |
| T 3 05/15/48       | 3.0   | 100    | 125    | 14,110    | 2048/8/15  |
| T 3 1/8 02/15/43   | 3.125 | 100    | 122    | 13,815    | 2043/2/15  |
| T 3 1/8 05/15/48   | 3.125 | 100    | 127    | 14,413    | 2048/5/15  |
| T 3 1/8 08/15/44   | 3.125 | 300    | 370    | 41,835    | 2044/8/15  |
| T 3 1/8 11/15/28   | 3.125 | 200    | 224    | 25,322    | 2028/11/15 |
| T 3 1/8 11/15/41   | 3.125 | 100    | 121    | 13,742    | 2041/11/15 |
| T 3 11/15/45       | 3.0   | 300    | 367    | 41,483    | 2045/11/15 |
| T 3 3/4 11/15/43   | 3.75  | 100    | 134    | 15,175    | 2043/11/15 |
| T 3 3/8 11/15/48   | 3.375 | 200    | 267    | 30,188    | 2048/11/15 |
| T 3 5/8 02/15/44   | 3.625 | 100    | 132    | 14,941    | 2044/2/15  |
| T 3 5/8 08/15/43   | 3.625 | 100    | 131    | 14,887    | 2043/8/15  |
| T 3 7/8 08/15/40   | 3.875 | 200    | 267    | 30,186    | 2040/8/15  |
| T 4 1/4 11/15/40   | 4.25  | 100    | 139    | 15,797    | 2040/11/15 |
| T 4 3/4 02/15/41   | 4.75  | 100    | 148    | 16,780    | 2041/2/15  |
| T 4 3/8 02/15/38   | 4.375 | 100    | 140    | 15,818    | 2038/2/15  |
| T 4 3/8 05/15/40   | 4.375 | 100    | 141    | 16,019    | 2040/5/15  |
| T 4 3/8 11/15/39   | 4.375 | 200    | 282    | 31,902    | 2039/11/15 |
| T 5 05/15/37       | 5.0   | 50     | 74     | 8,358     | 2037/5/15  |
| T 5 3/8 02/15/31   | 5.375 | 100    | 135    | 15,244    | 2031/2/15  |
| US TREASURY N/B    | 0.75  | 300    | 291    | 32,854    | 2028/1/31  |
| US TREASURY N/B    | 1.875 | 300    | 302    | 34,195    | 2051/2/15  |
| 小計                 |       |        |        | 4,578,570 |            |
| (カナダ)<br>国債証券      |       | 千カナダドル | 千カナダドル |           |            |
| CAN 0 1/2 09/01/25 | 0.5   | 100    | 97     | 8,824     | 2025/9/1   |
| CAN 0 1/2 11/01/23 | 0.5   | 100    | 99     | 8,995     | 2023/11/1  |
| CAN 0 1/2 12/01/30 | 0.5   | 100    | 90     | 8,242     | 2030/12/1  |
| CAN 0 1/4 03/01/26 | 0.25  | 100    | 95     | 8,668     | 2026/3/1   |
| CAN 0 1/4 04/01/24 | 0.25  | 100    | 98     | 8,905     | 2024/4/1   |

| 銘柄                   | 当期末     |         |        |         |            | 銘柄                  | 当期末  |      |       |        |            |  |
|----------------------|---------|---------|--------|---------|------------|---------------------|------|------|-------|--------|------------|--|
|                      | 利率      | 額面金額    | 評価額    |         | 償還年月日      |                     | 利率   | 額面金額 | 評価額   |        | 償還年月日      |  |
|                      |         |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |            |                     |      |      | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |            |  |
| (カナダ)<br>国債証券        | %       | 千カナダドル  | 千カナダドル | 千円      |            | (ユーロ…ドイツ)<br>国債証券   | %    | 千ユーロ | 千ユーロ  | 千円     |            |  |
| CAN 0 1/4 05/01/23   | 0.25    | 100     | 99     | 9,001   | 2023/5/1   | DBR 0 1/2 02/15/25  | 0.5  | 100  | 104   | 13,606 | 2025/2/15  |  |
| CAN 0 1/4 08/01/23   | 0.25    | 100     | 98     | 8,975   | 2023/8/1   | DBR 0 1/2 02/15/26  | 0.5  | 100  | 104   | 13,725 | 2026/2/15  |  |
| CAN 1 06/01/27       | 1.0     | 100     | 97     | 8,876   | 2027/6/1   | DBR 0 1/4 02/15/27  | 0.25 | 100  | 104   | 13,664 | 2027/2/15  |  |
| CAN 1 1/2 06/01/23   | 1.5     | 100     | 101    | 9,168   | 2023/6/1   | DBR 0 1/4 02/15/29  | 0.25 | 100  | 105   | 13,785 | 2029/2/15  |  |
| CAN 1 1/2 06/01/26   | 1.5     | 100     | 100    | 9,143   | 2026/6/1   | DBR 0 1/4 08/15/28  | 0.25 | 300  | 315   | 41,298 | 2028/8/15  |  |
| CAN 1 1/2 06/01/31   | 1.5     | 100     | 99     | 8,993   | 2031/6/1   | DBR 0 11/15/27      | —    | 200  | 206   | 27,027 | 2027/11/15 |  |
| CAN 1 1/4 03/01/25   | 1.25    | 100     | 100    | 9,099   | 2025/3/1   | DBR 0 11/15/28      | —    | 100  | 103   | 13,522 | 2028/11/15 |  |
| CAN 1 1/4 06/01/30   | 1.25    | 100     | 97     | 8,880   | 2030/6/1   | DBR 1 08/15/25      | 1.0  | 100  | 106   | 13,917 | 2025/8/15  |  |
| CAN 2 06/01/28       | 2.0     | 100     | 103    | 9,394   | 2028/6/1   | DBR 1 1/2 02/15/23  | 1.5  | 100  | 102   | 13,464 | 2023/2/15  |  |
| CAN 2 09/01/23       | 2.0     | 100     | 102    | 9,253   | 2023/9/1   | DBR 1 1/4 08/15/48  | 1.25 | 100  | 134   | 17,635 | 2048/8/15  |  |
| CAN 2 1/2 06/01/24   | 2.5     | 100     | 103    | 9,407   | 2024/6/1   | DBR 2 1/2 07/04/44  | 2.5  | 100  | 160   | 21,033 | 2044/7/4   |  |
| CAN 2 1/4 06/01/29   | 2.25    | 100     | 105    | 9,582   | 2029/6/1   | DBR 2 1/2 08/15/46  | 2.5  | 100  | 165   | 21,605 | 2046/8/15  |  |
| CAN 2 12/01/51       | 2.0     | 200     | 202    | 18,345  | 2051/12/1  | DBR 3 1/4 07/04/42  | 3.25 | 100  | 171   | 22,500 | 2042/7/4   |  |
| CAN 2 3/4 12/01/48   | 2.75    | 100     | 116    | 10,606  | 2048/12/1  | DBR 4 01/04/37      | 4.0  | 200  | 330   | 43,298 | 2037/1/4   |  |
| CAN 3 1/2 12/01/45   | 3.5     | 100     | 130    | 11,803  | 2045/12/1  | DBR 4 3/4 07/04/34  | 4.75 | 100  | 165   | 21,635 | 2034/7/4   |  |
| 小計                   |         |         |        | 194,168 |            | DBR 4 3/4 07/04/40  | 4.75 | 100  | 194   | 25,420 | 2040/7/4   |  |
| (メキシコ)<br>国債証券       | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ |        |         |            | DBR 4.25 07/04/39   | 4.25 | 100  | 180   | 23,614 | 2039/7/4   |  |
| MBONO 10 11/20/36    | 10.0    | 300     | 370    | 2,055   | 2036/11/20 | DBR 5.5 01/04/31    | 5.5  | 100  | 155   | 20,337 | 2031/1/4   |  |
| MBONO 10 12/05/24    | 10.0    | 600     | 649    | 3,604   | 2024/12/5  | DBR 6.5 07/04/27    | 6.5  | 100  | 140   | 18,446 | 2027/7/4   |  |
| MBONO 5 3/4 03/05/26 | 5.75    | 800     | 760    | 4,220   | 2026/3/5   | OBL 0 04/05/24      | —    | 300  | 305   | 39,977 | 2024/4/5   |  |
| MBONO 6 3/4 03/09/23 | 6.75    | 100     | 100    | 556     | 2023/3/9   | OBL 0 04/10/26      | —    | 100  | 102   | 13,448 | 2026/4/10  |  |
| MBONO 7 1/2 06/03/27 | 7.5     | 1,700   | 1,723  | 9,573   | 2027/6/3   | OBL 0 04/11/25      | —    | 200  | 204   | 26,787 | 2025/4/11  |  |
| MBONO 7 3/4 05/29/31 | 7.75    | 1,000   | 1,031  | 5,729   | 2031/5/29  | OBL 0 10/09/26      | —    | 100  | 102   | 13,461 | 2026/10/9  |  |
| MBONO 7 3/4 11/13/42 | 7.75    | 700     | 706    | 3,921   | 2042/11/13 | OBL 0 10/18/24      | —    | 200  | 204   | 26,729 | 2024/10/18 |  |
| MBONO 7 3/4 11/23/34 | 7.75    | 300     | 309    | 1,718   | 2034/11/23 | (ユーロ…イタリア)<br>国債証券  |      |      |       |        |            |  |
| MBONO 8 09/05/24     | 8.0     | 1,300   | 1,331  | 7,393   | 2024/9/5   | BTPS 0 01/15/24     | —    | 100  | 100   | 13,186 | 2024/1/15  |  |
| MBONO 8 1/2 05/31/29 | 8.5     | 1,500   | 1,610  | 8,945   | 2029/5/31  | BTPS 0 01/30/24     | —    | 100  | 99    | 13,059 | 2024/1/30  |  |
| MBONO 8 1/2 11/18/38 | 8.5     | 900     | 975    | 5,418   | 2038/11/18 | BTPS 0 04/01/26     | —    | 100  | 99    | 13,069 | 2026/4/1   |  |
| MBONO 8 11/07/47     | 8.0     | 800     | 825    | 4,586   | 2047/11/7  | BTPS 0 04/15/24     | —    | 100  | 100   | 13,182 | 2024/4/15  |  |
| MBONO 8 12/07/23     | 8.0     | 1,700   | 1,738  | 9,653   | 2023/12/7  | BTPS 0 1/2 02/01/26 | 0.5  | 100  | 102   | 13,369 | 2026/2/1   |  |
| 小計                   |         |         |        | 67,377  |            | BTPS 0 1/2 07/15/28 | 0.5  | 100  | 100   | 13,161 | 2028/7/15  |  |
| (ユーロ…ドイツ)<br>国債証券    | 千ユーロ    | 千ユーロ    |        |         |            | BTPS 0 1/4 03/15/28 | 0.25 | 100  | 99    | 12,999 | 2028/3/15  |  |
| BKO 0 03/10/23       | —       | 300     | 303    | 39,660  | 2023/3/10  | BTPS 0.3 08/15/23   | 0.3  | 400  | 405   | 53,090 | 2023/8/15  |  |
| BKO 0 06/16/23       | —       | 200     | 202    | 26,495  | 2023/6/16  | BTPS 0.35 02/01/25  | 0.35 | 200  | 203   | 26,634 | 2025/2/1   |  |
| DBR 0 02/15/30       | —       | 100     | 103    | 13,539  | 2030/2/15  | BTPS 0.6 08/01/31   | 0.6  | 100  | 98    | 12,842 | 2031/8/1   |  |
| DBR 0 02/15/31       | —       | 100     | 103    | 13,487  | 2031/2/15  | BTPS 0.85 01/15/27  | 0.85 | 300  | 310   | 40,673 | 2027/1/15  |  |
| DBR 0 05/15/35       | —       | 100     | 102    | 13,399  | 2035/5/15  | BTPS 0.95 03/01/23  | 0.95 | 100  | 101   | 13,339 | 2023/3/1   |  |
| DBR 0 05/15/36       | —       | 100     | 101    | 13,338  | 2036/5/15  | BTPS 0.95 03/01/37  | 0.95 | 100  | 96    | 12,612 | 2037/3/1   |  |
| DBR 0 08/15/26       | —       | 100     | 102    | 13,469  | 2026/8/15  | BTPS 0.95 08/01/30  | 0.95 | 100  | 102   | 13,385 | 2030/8/1   |  |
| DBR 0 08/15/29       | —       | 100     | 103    | 13,533  | 2029/8/15  | BTPS 0.95 12/01/31  | 0.95 | 100  | 100   | 13,204 | 2031/12/1  |  |
| DBR 0 08/15/30       | —       | 200     | 206    | 27,042  | 2030/8/15  | BTPS 1 1/2 06/01/25 | 1.5  | 100  | 105   | 13,853 | 2025/6/1   |  |
| DBR 0 08/15/31       | —       | 100     | 102    | 13,459  | 2031/8/15  | BTPS 1 3/4 07/01/24 | 1.75 | 100  | 105   | 13,788 | 2024/7/1   |  |
| DBR 0 08/15/50       | —       | 100     | 100    | 13,103  | 2050/8/15  | BTPS 1.45 11/15/24  | 1.45 | 100  | 105   | 13,741 | 2024/11/15 |  |

| 銘柄                   | 当期末  |      |      |        | 銘柄        | 当期末             |       |                       |      |      |     |                 |            |  |
|----------------------|------|------|------|--------|-----------|-----------------|-------|-----------------------|------|------|-----|-----------------|------------|--|
|                      | 利率   | 額面金額 | 評価額  |        |           | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 | 債還年月日 | 利率                    | 額面金額 | 評価額  |     | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 | 債還年月日      |  |
|                      |      |      | 千ユーロ | 千円     |           |                 |       |                       |      | 千ユーロ | 千円  |                 |            |  |
| (ユーロ…イタリア)<br>国債証券   | %    | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円     |           |                 |       | (ユーロ…フランス)<br>国債証券    | %    | 千ユーロ | 千円  |                 |            |  |
| BTPS 1.6 06/01/26    | 1.6  | 200  | 214  | 28,036 | 2026/6/1  |                 |       | FRTTR 0 1/2 06/25/44  | 0.5  | 100  | 98  | 12,890          | 2044/6/25  |  |
| BTPS 1.65 03/01/32   | 1.65 | 100  | 107  | 14,113 | 2032/3/1  |                 |       | FRTTR 0 1/4 11/25/26  | 0.25 | 100  | 103 | 13,544          | 2026/11/25 |  |
| BTPS 1.65 12/01/30   | 1.65 | 200  | 215  | 28,248 | 2030/12/1 |                 |       | FRTTR 0 11/25/29      | —    | 200  | 202 | 26,466          | 2029/11/25 |  |
| BTPS 1.8 03/01/41    | 1.8  | 100  | 106  | 13,907 | 2041/3/1  |                 |       | FRTTR 0 11/25/30      | —    | 200  | 200 | 26,286          | 2030/11/25 |  |
| BTPS 1.85 07/01/25   | 1.85 | 100  | 107  | 14,030 | 2025/7/1  |                 |       | FRTTR 0 11/25/31      | —    | 100  | 99  | 13,016          | 2031/11/25 |  |
| BTPS 2 02/01/28      | 2.0  | 100  | 110  | 14,456 | 2028/2/1  |                 |       | FRTTR 0 3/4 05/25/28  | 0.75 | 100  | 106 | 13,930          | 2028/5/25  |  |
| BTPS 2 1/4 09/01/36  | 2.25 | 100  | 114  | 15,004 | 2036/9/1  |                 |       | FRTTR 0 3/4 05/25/52  | 0.75 | 100  | 101 | 13,224          | 2052/5/25  |  |
| BTPS 2 12/01/25      | 2.0  | 100  | 108  | 14,185 | 2025/12/1 |                 |       | FRTTR 0 3/4 11/25/28  | 0.75 | 300  | 321 | 42,039          | 2028/11/25 |  |
| BTPS 2.45 09/01/33   | 2.45 | 100  | 116  | 15,214 | 2033/9/1  |                 |       | FRTTR 1 05/25/27      | 1.0  | 300  | 323 | 42,328          | 2027/5/25  |  |
| BTPS 2.45 09/01/50   | 2.45 | 100  | 118  | 15,468 | 2050/9/1  |                 |       | FRTTR 1 1/2 05/25/31  | 1.5  | 200  | 229 | 29,973          | 2031/5/25  |  |
| BTPS 2.7 03/01/47    | 2.7  | 100  | 123  | 16,144 | 2047/3/1  |                 |       | FRTTR 1 1/2 05/25/50  | 1.5  | 100  | 121 | 15,929          | 2050/5/25  |  |
| BTPS 2.95 09/01/38   | 2.95 | 100  | 125  | 16,417 | 2038/9/1  |                 |       | FRTTR 1 1/4 05/25/34  | 1.25 | 200  | 225 | 29,549          | 2034/5/25  |  |
| BTPS 3 08/01/29      | 3.0  | 200  | 237  | 31,098 | 2029/8/1  |                 |       | FRTTR 1 1/4 05/25/36  | 1.25 | 200  | 226 | 29,648          | 2036/5/25  |  |
| BTPS 3 1/2 03/01/30  | 3.5  | 100  | 123  | 16,169 | 2030/3/1  |                 |       | FRTTR 1 11/25/25      | 1.0  | 100  | 106 | 13,900          | 2025/11/25 |  |
| BTPS 3 1/4 09/01/46  | 3.25 | 100  | 134  | 17,609 | 2046/9/1  |                 |       | FRTTR 1 3/4 05/25/23  | 1.75 | 100  | 103 | 13,584          | 2023/5/25  |  |
| BTPS 3 3/4 09/01/24  | 3.75 | 100  | 111  | 14,562 | 2024/9/1  |                 |       | FRTTR 1 3/4 05/25/66  | 1.75 | 100  | 131 | 17,243          | 2066/5/25  |  |
| BTPS 3.35 03/01/35   | 3.35 | 100  | 127  | 16,721 | 2035/3/1  |                 |       | FRTTR 1 3/4 06/25/39  | 1.75 | 100  | 122 | 16,067          | 2039/6/25  |  |
| BTPS 3.45 03/01/48   | 3.45 | 100  | 139  | 18,300 | 2048/3/1  |                 |       | FRTTR 1 3/4 11/25/24  | 1.75 | 200  | 214 | 28,069          | 2024/11/25 |  |
| BTPS 4 02/01/37      | 4.0  | 100  | 138  | 18,155 | 2037/2/1  |                 |       | FRTTR 2 05/25/48      | 2.0  | 100  | 132 | 17,350          | 2048/5/25  |  |
| BTPS 4 1/2 03/01/24  | 4.5  | 100  | 111  | 14,550 | 2024/3/1  |                 |       | FRTTR 2 1/2 05/25/30  | 2.5  | 200  | 245 | 32,100          | 2030/5/25  |  |
| BTPS 4 1/2 05/01/23  | 4.5  | 100  | 107  | 14,061 | 2023/5/1  |                 |       | FRTTR 2 1/4 10/25/22  | 2.25 | 100  | 102 | 13,454          | 2022/10/25 |  |
| BTPS 4 3/4 08/01/23  | 4.75 | 100  | 109  | 14,274 | 2023/8/1  |                 |       | FRTTR 3 1/2 04/25/26  | 3.5  | 200  | 235 | 30,853          | 2026/4/25  |  |
| BTPS 4 3/4 09/01/28  | 4.75 | 100  | 129  | 16,894 | 2028/9/1  |                 |       | FRTTR 3 1/4 05/25/45  | 3.25 | 100  | 160 | 20,947          | 2045/5/25  |  |
| BTPS 4 3/4 09/01/44  | 4.75 | 100  | 162  | 21,310 | 2044/9/1  |                 |       | FRTTR 4 04/25/55      | 4.0  | 100  | 197 | 25,888          | 2055/4/25  |  |
| BTPS 5 08/01/34      | 5.0  | 100  | 147  | 19,258 | 2034/8/1  |                 |       | FRTTR 4 04/25/60      | 4.0  | 100  | 208 | 27,219          | 2060/4/25  |  |
| BTPS 5 08/01/39      | 5.0  | 100  | 158  | 20,735 | 2039/8/1  |                 |       | FRTTR 4 10/25/38      | 4.0  | 100  | 160 | 20,973          | 2038/10/25 |  |
| BTPS 5 09/01/40      | 5.0  | 100  | 160  | 21,008 | 2040/9/1  |                 |       | FRTTR 4 3/4 04/25/35  | 4.75 | 100  | 160 | 21,016          | 2035/4/25  |  |
| BTPS 5 1/2 11/01/22  | 5.5  | 200  | 211  | 27,702 | 2022/11/1 |                 |       | FRTTR 4 25 10/23      | 4.25 | 100  | 109 | 14,372          | 2023/10/25 |  |
| BTPS 5 3/4 02/01/33  | 5.75 | 100  | 151  | 19,863 | 2033/2/1  |                 |       | FRTTR 5 1/2 04/25/29  | 5.5  | 200  | 286 | 37,495          | 2029/4/25  |  |
| BTPS 6 05/01/31      | 6.0  | 100  | 148  | 19,434 | 2031/5/1  |                 |       | FRTTR 5 3/4 10/25/32  | 5.75 | 200  | 325 | 42,545          | 2032/10/25 |  |
| BTPS 6 1/2 11/01/27  | 6.5  | 100  | 136  | 17,896 | 2027/11/1 |                 |       | FRTTR 6 10/25/25      | 6.0  | 100  | 126 | 16,531          | 2025/10/25 |  |
| BTPS 7 1/4 11/01/26  | 7.25 | 100  | 135  | 17,745 | 2026/11/1 |                 |       | FRTTR 4.5 04/25/41    | 4.5  | 100  | 176 | 23,082          | 2041/4/25  |  |
| (ユーロ…フランス)<br>国債証券   |      |      |      |        |           |                 |       | (ユーロ…オランダ)<br>国債証券    |      |      |     |                 |            |  |
| FRTTR 0 02/25/23     | —    | 300  | 302  | 39,629 | 2023/2/25 |                 |       | NETHER 0 01/15/27     | —    | 100  | 102 | 13,420          | 2027/1/15  |  |
| FRTTR 0 02/25/24     | —    | 200  | 203  | 26,579 | 2024/2/25 |                 |       | NETHER 0 07/15/30     | —    | 100  | 102 | 13,355          | 2030/7/15  |  |
| FRTTR 0 02/25/26     | —    | 300  | 306  | 40,104 | 2026/2/25 |                 |       | NETHER 0 1/2 07/15/26 | 0.5  | 100  | 105 | 13,741          | 2026/7/15  |  |
| FRTTR 0 02/25/27     | —    | 100  | 102  | 13,356 | 2027/2/25 |                 |       | NETHER 0 1/4 07/15/25 | 0.25 | 100  | 103 | 13,508          | 2025/7/15  |  |
| FRTTR 0 03/25/23     | —    | 100  | 101  | 13,218 | 2023/3/25 |                 |       | NETHER 2 07/15/24     | 2.0  | 100  | 107 | 14,051          | 2024/7/15  |  |
| FRTTR 0 03/25/24     | —    | 200  | 203  | 26,597 | 2024/3/25 |                 |       | NETHER 2 1/2 01/15/33 | 2.5  | 100  | 129 | 16,935          | 2033/1/15  |  |
| FRTTR 0 03/25/25     | —    | 300  | 305  | 40,026 | 2025/3/25 |                 |       | NETHER 2 3/4 01/15/47 | 2.75 | 100  | 167 | 21,908          | 2047/1/15  |  |
| FRTTR 0 1/2 05/25/26 | 0.5  | 100  | 104  | 13,664 | 2026/5/25 |                 |       | NETHER 3 3/4 01/15/42 | 3.75 | 100  | 174 | 22,820          | 2042/1/15  |  |
| FRTTR 0 1/2 05/25/29 | 0.5  | 100  | 105  | 13,765 | 2029/5/25 |                 |       | NETHER 4 01/15/37     | 4.0  | 100  | 161 | 21,079          | 2037/1/15  |  |
| FRTTR 0 1/2 05/25/40 | 0.5  | 200  | 201  | 26,336 | 2040/5/25 |                 |       | NETHER 5 1/2 01/15/28 | 5.5  | 100  | 137 | 17,973          | 2028/1/15  |  |

| 銘柄                    | 当期末  |      |      |        | 銘柄         | 当期末                  |       |                 |       | 銘柄                 | 当期末        |      |      |    |                 |       |  |  |
|-----------------------|------|------|------|--------|------------|----------------------|-------|-----------------|-------|--------------------|------------|------|------|----|-----------------|-------|--|--|
|                       | 利率   | 額面金額 | 評価額  |        |            | 外貨建金額<br>邦貨換算金額      | 債還年月日 | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 | 債還年月日 |                    | 利率         | 額面金額 | 評価額  |    | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 | 債還年月日 |  |  |
|                       |      |      | 千ユーロ | 千円     |            |                      |       |                 |       |                    |            |      | 千ユーロ | 千円 |                 |       |  |  |
| (ユーロ…オランダ)<br>国債証券    | %    | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円     |            |                      |       |                 |       | (ユーロ…ベルギー)<br>国債証券 | %          | 千ユーロ | 千円   |    |                 |       |  |  |
| NETHER 7 1/2 01/15/23 | 7.5  | 100  | 109  | 14,371 | 2023/1/15  | BGB 1.6 06/22/47     | 1.6   | 100             | 121   | 15,839             | 2047/6/22  |      |      |    |                 |       |  |  |
| (ユーロ…スペイン)<br>国債証券    |      |      |      |        |            | BGB 1.9 06/22/38     | 1.9   | 100             | 123   | 16,205             | 2038/6/22  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 01/31/25       | —    | 300  | 304  | 39,794 | 2025/1/31  | BGB 3 3/4 06/22/45   | 3.75  | 100             | 170   | 22,288             | 2045/6/22  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 01/31/28       | —    | 100  | 99   | 13,075 | 2028/1/31  | BGB 4 1/4 03/28/41   | 4.25  | 100             | 169   | 22,239             | 2041/3/28  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 04/30/23       | —    | 100  | 100  | 13,208 | 2023/4/30  | BGB 5 03/28/35       | 5.0   | 100             | 163   | 21,409             | 2035/3/28  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 05/31/24       | —    | 200  | 201  | 26,401 | 2024/5/31  | BGB 5 1/2 03/28/28   | 5.5   | 100             | 138   | 18,102             | 2028/3/28  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 01/30/31       | 0.1  | 100  | 97   | 12,769 | 2031/4/30  | (ユーロ…オーストリア)<br>国債証券 |       |                 |       |                    |            |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 35 07/30/23    | 0.35 | 100  | 101  | 13,307 | 2023/7/30  | RAGB 0 07/15/24      | —     | 100             | 101   | 13,311             | 2024/7/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 45 10/31/22    | 0.45 | 100  | 100  | 13,200 | 2022/10/31 | RAGB 0 1/2 02/20/29  | 0.5   | 100             | 105   | 13,801             | 2029/2/20  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 6 10/31/29     | 0.6  | 100  | 103  | 13,521 | 2029/10/31 | RAGB 0 1/2 04/20/27  | 0.5   | 100             | 105   | 13,764             | 2027/4/20  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 0 8 07/30/27     | 0.8  | 200  | 210  | 27,483 | 2027/7/30  | RAGB 0 10/20/40      | —     | 100             | 94    | 12,325             | 2040/10/20 |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 1/4 10/31/30   | 1.25 | 100  | 108  | 14,210 | 2030/10/31 | RAGB 0 3/4 10/20/26  | 0.75  | 100             | 106   | 13,902             | 2026/10/20 |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 10/31/50       | 1.0  | 100  | 96   | 12,577 | 2050/10/31 | RAGB 1 1/2 02/20/47  | 1.5   | 100             | 127   | 16,696             | 2047/2/20  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 2 10/31/40     | 1.2  | 100  | 104  | 13,610 | 2040/10/31 | RAGB 1 3/4 10/20/23  | 1.75  | 100             | 104   | 13,717             | 2023/10/20 |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 3 10/31/26     | 1.3  | 100  | 107  | 14,064 | 2026/10/31 | RAGB 3 15 06/20/44   | 3.15  | 100             | 162   | 21,292             | 2044/6/20  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 4 07/30/28     | 1.4  | 100  | 109  | 14,340 | 2028/7/30  | RAGB 4 15 03/37      | 4.15  | 100             | 161   | 21,068             | 2037/3/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 45 10/31/27    | 1.45 | 100  | 109  | 14,290 | 2027/10/31 | (ユーロ…フィンランド)<br>国債証券 |       |                 |       |                    |            |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 85 07/30/35    | 1.85 | 100  | 115  | 15,104 | 2035/7/30  | RFGB 0 1/2 09/15/28  | 0.5   | 100             | 105   | 13,791             | 2028/9/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 95 04/30/26    | 1.95 | 100  | 110  | 14,402 | 2026/4/30  | RFGB 0 3/4 04/15/31  | 0.75  | 100             | 107   | 14,121             | 2031/4/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 1 95 07/30/30    | 1.95 | 200  | 229  | 30,059 | 2030/7/30  | RFGB 1 1/8 04/15/34  | 1.125 | 100             | 112   | 14,779             | 2034/4/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 2 3/4 10/31/24   | 2.75 | 100  | 109  | 14,355 | 2024/10/31 | RFGB 4 07/04/25      | 4.0   | 100             | 117   | 15,343             | 2025/7/4   |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 2 15 10/31/25    | 2.15 | 100  | 110  | 14,433 | 2025/10/31 | (ユーロ…アイルランド)<br>国債証券 |       |                 |       |                    |            |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 2 35 07/30/33    | 2.35 | 200  | 241  | 31,582 | 2033/7/30  | IRISH 0 2 10/18/30   | 0.2   | 100             | 101   | 13,287             | 2030/10/18 |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 2 7 10/31/48     | 2.7  | 100  | 137  | 17,948 | 2048/10/31 | IRISH 1 05/15/26     | 1.0   | 100             | 106   | 13,946             | 2026/5/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 2 9 10/31/46     | 2.9  | 100  | 141  | 18,447 | 2046/10/31 | IRISH 1 3 05/15/33   | 1.3   | 100             | 112   | 14,662             | 2033/5/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 3 45 07/30/66    | 3.45 | 100  | 159  | 20,864 | 2066/7/30  | IRISH 1 35 03/18/31  | 1.35  | 100             | 112   | 14,701             | 2031/3/18  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 4 2 01/31/37     | 4.2  | 100  | 151  | 19,769 | 2037/1/31  | IRISH 1 7 05/15/37   | 1.7   | 100             | 119   | 15,619             | 2037/5/15  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 4 4 10/31/23     | 4.4  | 100  | 110  | 14,392 | 2023/10/31 | IRISH 5 4 03/13/25   | 5.4   | 100             | 120   | 15,725             | 2025/3/13  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 4 7 07/30/41     | 4.7  | 100  | 170  | 22,241 | 2041/7/30  | ユーロ計                 |       |                 |       | 3,897,710          |            |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 4 8 01/31/24     | 4.8  | 100  | 111  | 14,633 | 2024/1/31  | (イギリス)<br>国債証券       |       |                 |       |                    |            |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 4 9 07/30/40     | 4.9  | 100  | 171  | 22,385 | 2040/7/30  | UKT 0 1/4 07/31/31   | 0.25  | 100             | 94    | 14,477             | 2031/7/31  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 5 3/4 07/30/32   | 5.75 | 100  | 156  | 20,473 | 2032/7/30  | UKT 0 1/8 01/30/26   | 0.125 | 200             | 196   | 30,112             | 2026/1/30  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 5 15 10/31/28    | 5.15 | 100  | 135  | 17,749 | 2028/10/31 | UKT 0 1/8 01/31/23   | 0.125 | 200             | 199   | 30,523             | 2023/1/31  |      |      |    |                 |       |  |  |
| SPGB 6 01/31/29       | 6.0  | 100  | 143  | 18,762 | 2029/1/31  | UKT 0 1/8 01/31/24   | 0.125 | 100             | 99    | 15,190             | 2024/1/31  |      |      |    |                 |       |  |  |
| (ユーロ…ベルギー)<br>国債証券    |      |      |      |        |            | UKT 0 5/8 06/07/25   | 0.625 | 100             | 100   | 15,398             | 2025/6/7   |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 0 1/2 10/22/24    | 0.5  | 100  | 103  | 13,554 | 2024/10/22 | UKT 0 5/8 07/31/35   | 0.625 | 100             | 95    | 14,634             | 2035/7/31  |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 0 2 10/22/23      | 0.2  | 100  | 101  | 13,325 | 2023/10/22 | UKT 0 5/8 10/22/50   | 0.625 | 100             | 92    | 14,119             | 2050/10/22 |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 0 8 06/22/25      | 0.8  | 100  | 105  | 13,751 | 2025/6/22  | UKT 1 04/22/24       | 1.0   | 100             | 101   | 15,527             | 2024/4/22  |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 0 8 06/22/27      | 0.8  | 100  | 106  | 13,990 | 2027/6/22  | UKT 1 1/2 07/22/47   | 1.5   | 100             | 112   | 17,162             | 2047/7/22  |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 0 9 06/22/29      | 0.9  | 100  | 108  | 14,202 | 2029/6/22  | UKT 1 1/4 07/22/27   | 1.25  | 100             | 103   | 15,891             | 2027/7/22  |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 1 06/22/26        | 1.0  | 100  | 107  | 14,007 | 2026/6/22  | UKT 1 1/4 10/22/41   | 1.25  | 100             | 104   | 15,954             | 2041/10/22 |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 1 06/22/31        | 1.0  | 100  | 110  | 14,403 | 2031/6/22  |                      |       |                 |       |                    |            |      |      |    |                 |       |  |  |
| BGB 1 1/4 04/22/33    | 1.25 | 100  | 113  | 14,842 | 2033/4/22  |                      |       |                 |       |                    |            |      |      |    |                 |       |  |  |

| 銘柄                       | 当期末   |             |                 |                   |
|--------------------------|-------|-------------|-----------------|-------------------|
|                          | 利率    | 額面金額        | 評価額             | 償還年月日             |
|                          |       |             | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                   |
| (イギリス)<br>国債証券           | %     | 千英ポンド       | 千英ポンド           | 千円                |
| UKT 1 3/4 09/07/37       | 1.75  | 100         | 111             | 17,016 2037/9/7   |
| UKT 1 5/8 10/22/28       | 1.625 | 100         | 106             | 16,346 2028/10/22 |
| UKT 2 09/07/25           | 2.0   | 100         | 105             | 16,194 2025/9/7   |
| UKT 2 1/2 07/22/65       | 2.5   | 100         | 162             | 24,914 2065/7/22  |
| UKT 2 1/4 09/07/23       | 2.25  | 100         | 103             | 15,816 2023/9/7   |
| UKT 3 1/2 01/22/45       | 3.5   | 100         | 152             | 23,275 2045/1/22  |
| UKT 3 1/2 07/22/68       | 3.5   | 100         | 206             | 31,589 2068/7/22  |
| UKT 3 1/4 01/22/44       | 3.25  | 100         | 144             | 22,154 2044/1/22  |
| UKT 3 3/4 07/22/52       | 3.75  | 100         | 175             | 26,853 2052/7/22  |
| UKT 4 1/2 12/07/42       | 4.5   | 100         | 166             | 25,523 2042/12/7  |
| UKT 4 1/4 03/07/36       | 4.25  | 100         | 144             | 22,125 2036/3/7   |
| UKT 4 1/4 12/07/27       | 4.25  | 30          | 36              | 5,587 2027/12/7   |
| UKT 4 1/4 12/07/40       | 4.25  | 100         | 156             | 23,997 2040/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/46       | 4.25  | 100         | 172             | 26,384 2046/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/49       | 4.25  | 100         | 181             | 27,813 2049/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/55       | 4.25  | 100         | 198             | 30,315 2055/12/7  |
| UKT 4 3/4 12/07/30       | 4.75  | 100         | 134             | 20,646 2030/12/7  |
| UKT 4 3/4 12/07/38       | 4.75  | 100         | 160             | 24,479 2038/12/7  |
| UKT 4.25 06/07/32        | 4.25  | 100         | 134             | 20,559 2032/6/7   |
| UKT 6 12/07/28           | 6.0   | 10          | 13              | 2,098 2028/12/7   |
| 小計                       |       |             | 622,684         |                   |
| (スウェーデン)<br>国債証券         |       | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ     |                   |
| SGB 0 1/8 05/12/31       | 0.125 | 200         | 198             | 2,608 2031/5/12   |
| SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 | 0.75  | 200         | 208             | 2,743 2028/5/12   |
| SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 | 0.75  | 300         | 314             | 4,133 2029/11/12  |
| SGB 1 1/2 11/13/23       | 1.5   | 300         | 310             | 4,083 2023/11/13  |
| SGB 1 11/12/26 #1059     | 1.0   | 300         | 314             | 4,144 2026/11/12  |
| SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 | 2.5   | 400         | 436             | 5,743 2025/5/12   |
| SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 | 2.25  | 100         | 120             | 1,584 2032/6/1    |
| SGB 3 1/2 03/30/39       | 3.5   | 200         | 300             | 3,957 2039/3/30   |
| 小計                       |       |             | 28,999          |                   |
| (ノルウェー)<br>国債証券          |       | 千ノルウェークラウン  | 千ノルウェークラウン      |                   |
| NGB 1 1/2 02/19/26       | 1.5   | 200         | 200             | 2,654 2026/2/19   |
| NGB 1 1/4 09/17/31       | 1.25  | 200         | 194             | 2,586 2031/9/17   |
| NGB 1 3/4 02/17/27       | 1.75  | 200         | 202             | 2,686 2027/2/17   |
| NGB 1 3/4 03/13/25       | 1.75  | 200         | 201             | 2,679 2025/3/13   |
| NGB 1 3/4 09/06/29       | 1.75  | 100         | 101             | 1,343 2029/9/6    |
| NGB 1 3/8 08/19/30       | 1.375 | 200         | 196             | 2,607 2030/8/19   |
| NGB 2 04/26/28           | 2.0   | 100         | 102             | 1,362 2028/4/26   |
| NGB 2 05/24/23           | 2.0   | 300         | 304             | 4,036 2023/5/24   |
| NGB 3 03/14/24           | 3.0   | 300         | 311             | 4,128 2024/3/14   |
| 小計                       |       |             | 24,084          |                   |

| 銘柄                   | 当期末  |            |                 |                   |
|----------------------|------|------------|-----------------|-------------------|
|                      | 利率   | 額面金額       | 評価額             | 償還年月日             |
|                      |      |            | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                   |
| (デンマーク)<br>国債証券      | %    | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ      | 千円                |
| DGB 0 1/2 11/15/27   | 0.5  | 300        | 314             | 5,538 2027/11/15  |
| DGB 0 1/2 11/15/29   | 0.5  | 400        | 422             | 7,428 2029/11/15  |
| DGB 0 1/4 11/15/22   | 0.25 | 200        | 201             | 3,549 2022/11/15  |
| DGB 0 1/4 11/15/52   | 0.25 | 200        | 201             | 3,538 2052/11/15  |
| DGB 0 11/15/24       | —    | 100        | 101             | 1,785 2024/11/15  |
| DGB 0 11/15/31       | —    | 200        | 200             | 3,531 2031/11/15  |
| DGB 1 1/2 11/15/23   | 1.5  | 200        | 208             | 3,671 2023/11/15  |
| DGB 1 3/4 11/15/25   | 1.75 | 200        | 218             | 3,835 2025/11/15  |
| DGB 4 1/2 11/15/39   | 4.5  | 500        | 896             | 15,760 2039/11/15 |
| 小計                   |      |            |                 | 48,639            |
| (ポーランド)<br>国債証券      |      | 千ポーランドズロチ  | 千ポーランドズロチ       |                   |
| POLGB 0 04/25/23     | —    | 100        | 96              | 2,735 2023/4/25   |
| POLGB 0 1/4 10/25/26 | 0.25 | 100        | 88              | 2,510 2026/10/25  |
| POLGB 0 3/4 04/25/25 | 0.75 | 200        | 186             | 5,312 2025/4/25   |
| POLGB 1 1/4 10/25/30 | 1.25 | 100        | 87              | 2,493 2030/10/25  |
| POLGB 2 1/2 01/25/23 | 2.5  | 200        | 199             | 5,691 2023/1/25   |
| POLGB 2 1/2 04/25/24 | 2.5  | 100        | 99              | 2,819 2024/4/25   |
| POLGB 2 1/2 07/25/26 | 2.5  | 200        | 197             | 5,618 2026/7/25   |
| POLGB 2 1/2 07/25/27 | 2.5  | 100        | 98              | 2,799 2027/7/25   |
| POLGB 2 1/4 10/25/24 | 2.25 | 200        | 197             | 5,610 2024/10/25  |
| POLGB 2 3/4 04/25/28 | 2.75 | 200        | 197             | 5,627 2028/4/25   |
| POLGB 2 3/4 10/25/29 | 2.75 | 200        | 199             | 5,667 2029/10/25  |
| POLGB 3 1/4 07/25/25 | 3.25 | 100        | 101             | 2,889 2025/7/25   |
| 小計                   |      |            |                 | 49,776            |
| (オーストラリア)<br>国債証券    |      | 千豪ドル       | 千豪ドル            |                   |
| ACGB 0 1/2 09/21/26  | 0.5  | 100        | 96              | 8,005 2026/9/21   |
| ACGB 0 1/4 11/21/25  | 0.25 | 100        | 96              | 8,025 2025/11/21  |
| ACGB 1 1/2 06/21/31  | 1.5  | 200        | 195             | 16,294 2031/6/21  |
| ACGB 1 1/4 05/21/32  | 1.25 | 100        | 94              | 7,875 2032/5/21   |
| ACGB 1 12/21/30      | 1.0  | 100        | 93              | 7,808 2030/12/21  |
| ACGB 1 3/4 06/21/51  | 1.75 | 100        | 84              | 7,061 2051/6/21   |
| ACGB 2 1/2 05/21/30  | 2.5  | 100        | 106             | 8,877 2030/5/21   |
| ACGB 2 1/4 05/21/28  | 2.25 | 100        | 104             | 8,722 2028/5/21   |
| ACGB 2 3/4 04/21/24  | 2.75 | 200        | 210             | 17,515 2024/4/21  |
| ACGB 2 3/4 11/21/27  | 2.75 | 200        | 215             | 17,911 2027/11/21 |
| ACGB 2 3/4 11/21/29  | 2.75 | 100        | 108             | 9,030 2029/11/21  |
| ACGB 3 03/21/47      | 3.0  | 100        | 110             | 9,167 2047/3/21   |
| ACGB 3 1/4 04/21/25  | 3.25 | 100        | 107             | 8,943 2025/4/21   |
| ACGB 3 1/4 04/21/29  | 3.25 | 100        | 111             | 9,298 2029/4/21   |
| ACGB 4 1/2 04/21/33  | 4.5  | 100        | 127             | 10,630 2033/4/21  |
| ACGB 4 1/4 04/21/26  | 4.25 | 100        | 113             | 9,417 2026/4/21   |

| 銘柄                  | 当期末   |          |                 |                 |
|---------------------|-------|----------|-----------------|-----------------|
|                     | 利率    | 額面金額     | 評価額             | 償還年月日           |
|                     |       |          | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                 |
| (オーストラリア)<br>国債証券   | %     | 千豪ドル     | 千豪ドル            | 千円              |
| ACGB 5 1/2 04/21/23 | 5.5   | 100      | 107             | 8,924 2023/4/21 |
| 小計                  |       |          | 173,511         |                 |
| (シンガポール)<br>国債証券    |       | シンガポールドル | シンガポールドル        |                 |
| SIGB 2 1/4 08/01/36 | 2.25  | 100      | 103             | 8,704 2036/8/1  |
| SIGB 2 1/8 06/01/26 | 2.125 | 100      | 103             | 8,702 2026/6/1  |
| SIGB 3 1/2 03/01/27 | 3.5   | 200      | 220             | 18,485 2027/3/1 |
| SIGB 3 3/8 09/01/33 | 3.375 | 100      | 115             | 9,689 2033/9/1  |
| 小計                  |       |          | 45,582          |                 |
| (マレーシア)<br>国債証券     |       | マレーシア元   | マレーシア元          |                 |
| MGS 2.632 04/15/31  | 2.632 | 100      | 92              | 2,517 2031/4/15 |
| MGS 3.48 03/15/23   | 3.48  | 200      | 203             | 5,531 2023/3/15 |
| MGS 3.502 05/31/27  | 3.502 | 100      | 101             | 2,751 2027/5/31 |
| MGS 3.733 06/15/28  | 3.733 | 100      | 102             | 2,779 2028/6/15 |
| MGS 3.757 05/22/40  | 3.757 | 100      | 94              | 2,570 2040/5/22 |
| MGS 3.828 07/05/34  | 3.828 | 100      | 97              | 2,638 2034/7/5  |
| MGS 3.844 04/15/33  | 3.844 | 100      | 98              | 2,679 2033/4/15 |
| MGS 3.885 08/15/29  | 3.885 | 100      | 102             | 2,779 2029/8/15 |
| MGS 3.955 09/15/25  | 3.955 | 100      | 103             | 2,811 2025/9/15 |
| MGS 4.181 07/15/24  | 4.181 | 100      | 103             | 2,819 2024/7/15 |
| MGS 4.254 05/31/35  | 4.254 | 100      | 102             | 2,783 2035/5/31 |
| MGS 4.392 04/15/26  | 4.392 | 100      | 105             | 2,862 2026/4/15 |
| MGS 4.498 04/15/30  | 4.498 | 100      | 106             | 2,885 2030/4/15 |
| MGS 4.736 03/15/46  | 4.736 | 100      | 104             | 2,841 2046/3/15 |
| MGS 4.762 04/07/37  | 4.762 | 100      | 106             | 2,882 2037/4/7  |
| MGS 5.248 09/28     | 5.248 | 100      | 111             | 3,021 2028/9/15 |
| 小計                  |       |          | 47,154          |                 |

| 銘柄                   | 当期末  |          |                 |                  |
|----------------------|------|----------|-----------------|------------------|
|                      | 利率   | 額面金額     | 評価額             | 償還年月日            |
|                      |      |          | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                  |
| (イスラエル)<br>国債証券      | %    | 千イスラエルペソ | 千イスラエルペソ        | 千円               |
| ILGOV 1 03/31/30     | —    | 100      | 99              | 3,601 2030/3/31  |
| ILGOV 1 1/2 11/30/23 | —    | 100      | 103             | 3,777 2023/11/30 |
| ILGOV 1 3/4 08/31/25 | —    | 100      | 104             | 3,803 2025/8/31  |
| ILGOV 2 03/31/27     | —    | 200      | 215             | 7,812 2027/3/31  |
| ILGOV 2 1/4 09/28/28 | —    | 100      | 108             | 3,949 2028/9/28  |
| ILGOV 3 3/4 03/31/24 | —    | 100      | 110             | 4,012 2024/3/31  |
| ILGOV 3 3/4 03/31/47 | —    | 100      | 130             | 4,731 2047/3/31  |
| ILGOV 4 1/4 03/31/23 | —    | 100      | 108             | 3,935 2023/3/31  |
| ILGOV 5 1/2 01/31/42 | —    | 100      | 162             | 5,894 2042/1/31  |
| ILGOV 6 1/4 10/30/26 | —    | 100      | 127             | 4,616 2026/10/30 |
| 小計                   |      |          |                 | 46,133           |
| (中国)<br>国債証券         |      | 千中国元     | 千中国元            |                  |
| CGB 2.57 05/20/23    | 2.57 | 200      | 200             | 3,538 2023/5/20  |
| CGB 2.84 04/08/24    | 2.84 | 100      | 100             | 1,778 2024/4/8   |
| CGB 2.85 06/04/27    | 2.85 | 100      | 100             | 1,770 2027/6/4   |
| CGB 3.01 05/13/28    | 3.01 | 100      | 100             | 1,778 2028/5/13  |
| CGB 3.02 10/22/25    | 3.02 | 100      | 101             | 1,787 2025/10/22 |
| CGB 3.03 03/11/26    | 3.03 | 100      | 101             | 1,789 2026/3/11  |
| CGB 3.27 11/19/30    | 3.27 | 100      | 102             | 1,813 2030/11/19 |
| CGB 3.29 05/23/29    | 3.29 | 100      | 102             | 1,813 2029/5/23  |
| CGB 3.81 09/14/50    | 3.81 | 100      | 106             | 1,876 2050/9/14  |
| 小計                   |      |          |                 | 17,945           |
| 合計                   |      |          |                 | 9,842,338        |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

## ○投資信託財産の構成

(2021年11月10日現在)

| 項<br>目       | 当<br>期<br>末     |           |
|--------------|-----------------|-----------|
|              | 評<br>価<br>額     | 比<br>率    |
| 公社債          | 千円<br>9,842,339 | %<br>99.0 |
| コール・ローン等、その他 | 99,801          | 1.0       |
| 投資信託財産総額     | 9,942,140       | 100.0     |

(注) 当期末における外貨建純資産(9,910,916千円)の投資信託財産総額(9,942,140千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは  
 1米ドル=112.86円、1カナダドル=90.70円、1メキシコペソ=5.5529円、1ユーロ=130.83円、1英ポンド=152.97円、1スウェーデンクローナ=13.16円、1ノルウェークローネ=13.27円、1デンマーククローネ=17.59円、1ポーランドズロチ=28.4806円、1豪ドル=83.21円、1シンガポールドル=83.79円、1マレーシアリンギット=27.1906円、1イスラエルシェケル=36.33円、1オフショア元=17.6645円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年11月10日現在)

| 項<br>目          | 当<br>期<br>末        |
|-----------------|--------------------|
| (A) 資産          | 円<br>9,942,140,297 |
| コール・ローン等        | 45,920,409         |
| 公社債(評価額)        | 9,842,339,064      |
| 未収利息            | 50,666,401         |
| 前払費用            | 3,214,423          |
| (B) 負債          | 32,027,353         |
| 未払解約金           | 32,027,296         |
| 未払利息            | 57                 |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 9,910,112,944      |
| 元本              | 5,630,915,772      |
| 次期繰越損益金         | 4,279,197,172      |
| (D) 受益権総口数      | 5,630,915,772口     |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,599円            |

(注) 当親ファンドの期首元本額は4,126,162,688円、期中追加設定元本額は2,414,085,443円、期中一部解約元本額は909,332,359円です。

## &lt;元本の内訳&gt;

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 東京海上セレクション・外国債券インデックス          | 3,715,868,836円 |
| 東京海上・世界インデックス・バランス60×適格機関投資家限定 | 1,224,444,582円 |
| 東京海上・世界インデックス・バランス40×適格機関投資家限定 | 366,201,762円   |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)       | 170,789,065円   |
| TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>     | 67,201,860円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035         | 35,248,521円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065         | 23,423,269円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045         | 16,654,942円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055         | 11,082,935円    |

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

## ○損益の状況 (2020年11月11日～2021年11月10日)

| 項<br>目           | 当<br>期<br>円   |
|------------------|---------------|
| (A) 配当等収益        | 144,916,947   |
| 受取利息             | 144,930,091   |
| 支払利息             | △ 13,144      |
| (B) 有価証券売買損益     | 312,305,543   |
| 売買益              | 566,330,250   |
| 売買損              | △ 254,024,707 |
| (C) 保管費用等        | △ 1,398,760   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 455,823,730   |
| (E) 前期繰越損益金      | 2,752,566,430 |
| (F) 追加信託差損益金     | 1,716,635,470 |
| (G) 解約差損益金       | △ 645,828,458 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 4,279,197,172 |
| 次期繰越損益金(H)       | 4,279,197,172 |

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。