

# ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 外国株式

## 運用報告書(全体版)

第5期 (決算日2021年3月29日)

作成対象期間 (2020年3月31日～2021年3月29日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●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/株式   |
| 信託期間   | 2016年10月20日以降、無期限とします。  |
| 運用方針   | 主として、世界各国(新興国を含みます。)の株式(DR(預託証券)を含みます。)を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資し、信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。<br>投資する投資信託証券については、実質的な外貨建て資産について為替ヘッジを行うことを基本とするものもしくはこれらに類するもの、および実質的な外貨建て資産について為替ヘッジを行わないことを基本とするものもしくはこれらに類するもの、これらのいずれにも投資できるものとします。<br>投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエアによる各投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析および投資環境等の定性判断等に基づく投資配分比率に関する助言(為替に関連する各種指標等も勘案します。)をもとに各投資信託証券への配分比率を決定します。なお、組入投資信託証券については適宜見直しを行います。 |
| 主な投資対象 | 主として有価証券に投資する投資信託証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。   |
| 主な投資制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。  |
| 配分方針   | 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と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。   |

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104  
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○設定以来の運用実績

| 決算期                  | 基準価額        |        |        | 参考指数   |        | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額    |
|----------------------|-------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------------|----------|
|                      | (分配落)       | 税込分配金  | 期中騰落率  | 期中騰落率  | 期中騰落率  |        |        |            |          |
| (設定日)<br>2016年10月20日 | 円<br>10,000 | 円<br>— | %<br>— | 100.00 | %<br>— | %<br>— | %<br>— | %<br>—     | 百万円<br>1 |
| 1期(2017年3月29日)       | 11,069      | 0      | 10.7   | 116.67 | 16.7   | 93.6   | 2.1    | 3.0        | 170      |
| 2期(2018年3月29日)       | 11,836      | 5      | 7.0    | 124.91 | 7.1    | 94.5   | 1.7    | 3.1        | 1,150    |
| 3期(2019年3月29日)       | 12,727      | 5      | 7.6    | 131.96 | 5.6    | 94.7   | 0.9    | 3.4        | 3,386    |
| 4期(2020年3月30日)       | 11,074      | 5      | △12.9  | 110.02 | △16.6  | 83.8   | 2.3    | 11.5       | 6,527    |
| 5期(2021年3月29日)       | 17,176      | 5      | 55.1   | 174.58 | 58.7   | 91.6   | 1.7    | 6.0        | 12,091   |

\*基準価額の騰落率は分配金込み。

\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*参考指数(=MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース))は、MSCI All Country World Index ex Japanをもとに、当社が独自に円換算したものです。算出にあたっては、当社がファンドにおける組入資産・為替の評価時点に合わせて計算を行っています。従って、MSCIが公表するものとは異なります。なお、設定時を100として指数化しております。

\*MSCI All Country World Index ex Japanは、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数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。

(出所) MSCI、ファクトセット、為替レート(対顧客電信売買相場仲値)

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日                | 基準価額        |        | 参考指数   |        | 株式組入比率    | 株式先物比率   | 投資信託証券組入比率 |
|--------------------|-------------|--------|--------|--------|-----------|----------|------------|
|                    | 騰落率         | 騰落率    | 騰落率    | 騰落率    |           |          |            |
| (期首)<br>2020年3月30日 | 円<br>11,074 | %<br>— | 110.02 | %<br>— | %<br>83.8 | %<br>2.3 | %<br>11.5  |
| 3月末                | 11,418      | 3.1    | 113.45 | 3.1    | 84.7      | 2.4      | 11.6       |
| 4月末                | 12,531      | 13.2   | 124.29 | 13.0   | 84.3      | 2.2      | 12.5       |
| 5月末                | 13,002      | 17.4   | 128.89 | 17.1   | 83.5      | 2.5      | 13.1       |
| 6月末                | 13,276      | 19.9   | 132.13 | 20.1   | 84.1      | 1.4      | 13.3       |
| 7月末                | 13,739      | 24.1   | 136.84 | 24.4   | 84.4      | 1.2      | 13.0       |
| 8月末                | 14,695      | 32.7   | 146.56 | 33.2   | 84.2      | 1.3      | 13.1       |
| 9月末                | 14,164      | 27.9   | 140.59 | 27.8   | 85.0      | 2.5      | 11.7       |
| 10月末               | 13,855      | 25.1   | 137.78 | 25.2   | 85.7      | 1.8      | 11.8       |
| 11月末               | 15,239      | 37.6   | 153.03 | 39.1   | 86.2      | 1.6      | 10.7       |
| 12月末               | 15,655      | 41.4   | 157.25 | 42.9   | 87.4      | 1.6      | 9.7        |
| 2021年1月末           | 16,055      | 45.0   | 161.62 | 46.9   | 87.4      | 1.6      | 9.8        |
| 2月末                | 16,464      | 48.7   | 167.11 | 51.9   | 86.4      | 1.2      | 9.4        |
| (期末)<br>2021年3月29日 | 17,181      | 55.1   | 174.58 | 58.7   | 91.6      | 1.7      | 6.0        |

\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

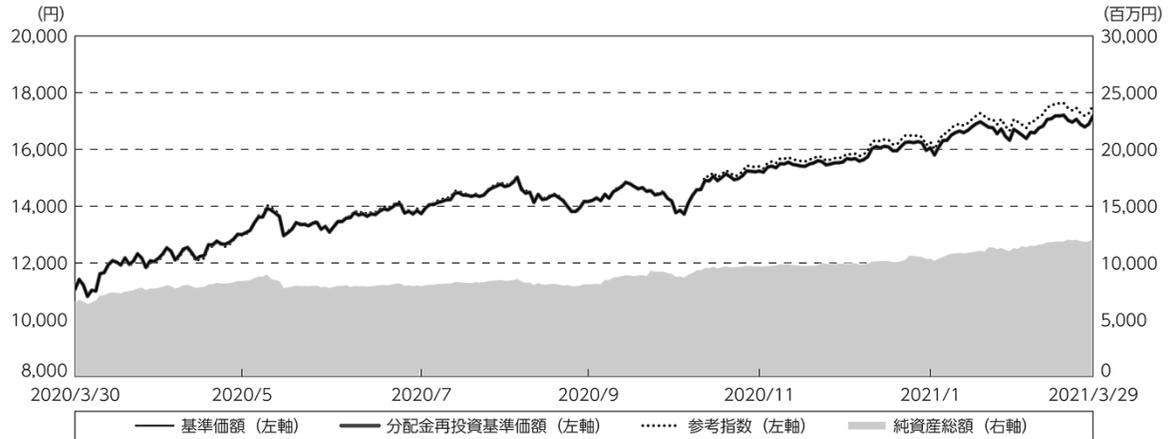
\*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期首：11,074円

期末：17,176円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：55.1% (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。作成期首(2020年3月30日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース)です。参考指数は、作成期首(2020年3月30日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首11,074円から期末17,176円となりました。

#### (上昇要因)

- ・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」が値上がりしたこと
- ・「野村グローバル株IPストラテジー マザーファンド」が値上がりしたこと

## ○投資環境

### <世界株式市場>

市場予想を上回る米欧の経済指標や新型コロナウイルスのワクチン実用化への期待、FRB（米連邦準備制度理事会）のゼロ金利政策の長期化観測、米大統領選で民主党のバイデン氏が優勢となり米政治の不透明感が和らいだこと、米国の大規模な追加経済対策の成立などを背景に、当作成期間では値上がりとなりました。

### <為替市場>

米ドルは、米中対立への懸念が高まったことや、FRBによる金融緩和の長期化観測などを受けて円に対して下落（円高）した場面がありましたが、新型コロナウイルスのワクチン接種の普及に伴う景気回復期待や大規模な追加経済対策の成立などを背景に、当作成期間では円に対して上昇（円安）しました。ユーロは、各国の経済活動再開による景気回復期待、ワクチン普及による世界経済正常化への期待が高まったこと、ECB（欧州中央銀行）が資産買い入れを積極化する姿勢を示したことなどを背景に、当作成期間では円に対して上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）※を含みます。）を実質的な投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行いました。

投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエア（以下「ウエルス・スクエア」という）からの助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案して指定投資信託証券の選定および投資信託証券への投資配分比率の決定を行いました。

※Depository Receipt（預託証券）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRIは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

### ・投資信託証券組入比率

投資方針に基づいて、当作成期を通じて高位の組入れを維持しました。

### ・指定投資信託証券の見直し

ウエルス・スクエアからの助言に基づき、当期において「新興国株式マザーファンド」を新規に組み入れた一方、「野村エマージング株IPストラテジー マザーファンド」を除外しました。

## ・指定投資信託証券の組入れ比率推移

| ファンド名                                | 期首    | 3月末   | 4月末   | 5月末   | 6月末   | 7月末   | 8月末   | 9月末   | 10月末  | 11月末  | 12月末  | 1月末   | 2月末   | 期末    |
|--------------------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 外国株式MSCI-KOKUSAI<br>マザーファンド          | 44.0% | 44.6% | 43.0% | 42.1% | 41.8% | 41.5% | 41.8% | 42.8% | 41.6% | 43.7% | 44.5% | 45.6% | 48.0% | 57.6% |
| 野村オール海外ストック最小分散<br>ポートフォリオ マザーファンド   | 8.2%  | 8.1%  | 8.7%  | 8.8%  | 9.0%  | 8.9%  | 7.7%  | 6.9%  | 7.0%  | 5.8%  | 4.0%  | 3.1%  | 2.9%  | 3.0%  |
| 野村グローバル株IP<br>ストラテジー マザーファンド         | 25.2% | 25.2% | 24.9% | 24.1% | 22.9% | 21.8% | 20.6% | 22.1% | 20.8% | 20.8% | 20.8% | 19.0% | 16.0% | 16.2% |
| 野村エマーシング株IP<br>ストラテジー マザーファンド        | 5.9%  | 5.7%  | 6.0%  | 5.8%  | 4.9%  | 3.0%  | 1.9%  | 1.9%  | 2.1%  | 1.0%  | —     | —     | —     | —     |
| 外国株式為替ヘッジ型<br>マザーファンド                | 6.8%  | 6.8%  | 7.1%  | 7.9%  | 7.9%  | 8.0%  | 9.0%  | 9.0%  | 10.0% | 10.1% | 10.9% | 9.9%  | 7.9%  | 5.0%  |
| NEXT FUNDS<br>NASDAQ-100®<br>連動型上場投信 | 6.2%  | 6.2%  | 5.9%  | 5.9%  | 5.7%  | 5.4%  | 5.4%  | 4.0%  | 3.5%  | 2.5%  | 1.3%  | 1.1%  | 1.0%  | —     |
| 新興国株式<br>マザーファンド                     | —     | —     | —     | —     | 1.5%  | 4.9%  | 6.9%  | 6.9%  | 8.3%  | 9.0%  | 10.8% | 13.3% | 14.9% | 13.5% |
| インベスコ<br>QQQ 信託シリーズ1                 | 2.6%  | 2.7%  | 3.8%  | 4.8%  | 5.4%  | 5.6%  | 6.0%  | 5.9%  | 6.4%  | 6.4%  | 6.6%  | 6.9%  | 6.6%  | 4.0%  |

## ○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おりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

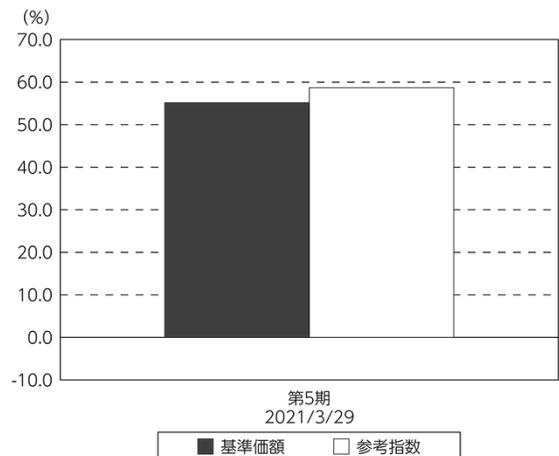
参考指数の騰落率が+58.7%となったのに対して、基準価額は+55.1%となりました。

### 【主な差異要因】

#### (マイナス要因)

〔野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ マザーファンド〕が、世界株式市場の平均を下回る騰落率となったこと

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、円換算ベース）です。

## ◎分配金

収益分配金については、基準価額水準等を勘案して決定しました。  
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目                | 第5期                       |
|--------------------|---------------------------|
|                    | 2020年3月31日～<br>2021年3月29日 |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 5<br>0.029%               |
| 当期の収益              | 5                         |
| 当期の収益以外            | —                         |
| 翌期繰越分配対象額          | 7,176                     |

(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、ファンドの収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

投資信託証券への投資にあたっては、ウエルス・スクエアからの助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案して指定投資信託証券の選定および投資信託証券への配分比率の決定を行います。

ウエルス・スクエアはポートフォリオの構築に当たり、投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析および投資環境等の定性判断等に基づき、投資配分比率に関する助言を行います。

組入投資信託証券については適宜見直しを行います。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行うための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年3月31日～2021年3月29日)

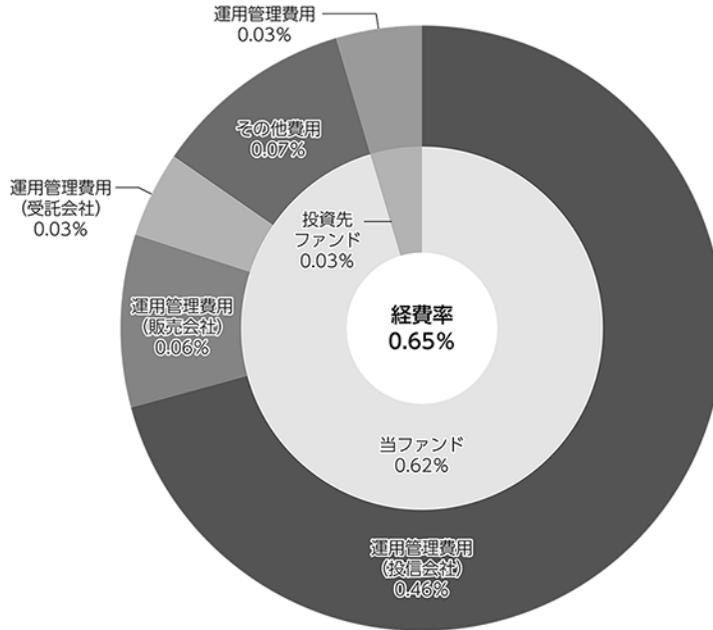
| 項 目                   | 当 期  |         | 項 目 の 概 要  |
|-----------------------|------|---------|--|
|                       | 金 額  | 比 率     |  |
| (a) 信 託 報 酬           | 78   | 0.548   | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率   |
| （ 投 信 会 社 ）           | (65) | (0.461) | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等                             |
| （ 販 売 会 社 ）           | ( 8) | (0.055) | 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                           |
| （ 受 託 会 社 ）           | ( 5) | (0.033) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等  |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料     | 4    | 0.025   | (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 ）               | ( 3) | (0.020) |  |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ）     | ( 0) | (0.000) |  |
| （ 投 資 信 託 証 券 ）       | ( 0) | (0.003) |  |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）   | ( 0) | (0.002) |  |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税     | 2    | 0.016   | (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 ）               | ( 2) | (0.016) |  |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ）     | ( 0) | (0.000) |  |
| （ 投 資 信 託 証 券 ）       | ( 0) | (0.000) |  |
| (d) そ の 他 費 用         | 10   | 0.070   | (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 ）           | ( 9) | (0.065) | 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 ）           | ( 0) | (0.003) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用  |
| （ そ の 他 ）             | ( 0) | (0.002) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用   |
| 合 計                   | 94   | 0.659   |  |
| 期中の平均基準価額は、14,174円です。 |      |         |  |

\* 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。  
 \* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
 \* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンド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。  
 \* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。  
 \* 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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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、売買委託手数料及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経費率（年率）は0.65%です。



(単位:%)

|                    |      |
|--------------------|------|
| 経費率(①+②)           | 0.65 |
| ①当ファンドの費用の比率       | 0.62 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.03 |

(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、売買委託手数料及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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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

(2020年3月31日～2021年3月29日)

### 投資信託証券

| 銘柄 |  | 買付     |       | 売付     |         |
|----|--|--------|-------|--------|---------|
|    |  | 口数     | 金額    | 口数     | 金額      |
| 国内 | NEXT FUNDS NASDAQ-100 <sup>®</sup> 連動型上場投信 | 口      | 千円    | 口      | 千円      |
|    |  | —      | —     | 48,300 | 603,726 |
| 外国 | アメリカ                                       |        | 千米ドル  |        | 千米ドル    |
|    | インベスコ QQQ信託シリーズ1                           | 15,200 | 3,844 | 9,500  | 2,991   |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄                     |                     | 設定        |           | 解約      |           |
|------------------------|---------------------|-----------|-----------|---------|-----------|
|                        |                     | 口数        | 金額        | 口数      | 金額        |
|                        |                     | 千口        | 千円        | 千口      | 千円        |
| 外国株式                   | MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 910,461   | 3,046,643 | 288,803 | 845,939   |
| 外国株式                   | 為替ヘッジ型マザーファンド       | 284,420   | 607,997   | 316,222 | 759,621   |
| 新興国株式                  | マザーファンド             | 1,251,263 | 1,800,176 | 236,842 | 370,698   |
| 野村グローバル株IPストラテジー       | マザーファンド             | 322,325   | 586,086   | 596,038 | 1,122,320 |
| 野村エマージング株IPストラテジー      | マザーファンド             | 120,458   | 95,746    | 651,597 | 578,379   |
| 野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ | マザーファンド             | 217,378   | 304,983   | 399,090 | 575,310   |

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2020年3月31日～2021年3月29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                              |                           |                  |                                 |                                  |                                       |
|---------------------|---------------------------------|---------------------------|------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------------|
|                     | 外国株式<br>MSCI-KOKUSAI<br>マザーファンド | 外国株式<br>為替ヘッジ型<br>マザーファンド | 新興国株式<br>マザーファンド | 野村グローバル株<br>IPストラテジー<br>マザーファンド | 野村エマージング株<br>IPストラテジー<br>マザーファンド | 野村オール海外ストック<br>最小分散ポートフォリオ<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 175,459,142千円                   | 29,272,432千円              | 16,385,437千円     | 2,442,196千円                     | 865,256千円                        | 3,060,172千円                           |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 683,157,739千円                   | 49,999,178千円              | 45,966,679千円     | 1,920,687千円                     | 445,639千円                        | 1,820,493千円                           |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.25                            | 0.58                      | 0.35             | 1.27                            | 1.94                             | 1.68                                  |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年3月31日～2021年3月29日)

利害関係人との取引状況

<ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式>

| 区 分    | 買付額等<br>A  | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C  | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|------------|--------------------|---------------|------------|--------------------|---------------|
|        |            |                    |               |            |                    |               |
| 投資信託証券 | 百万円<br>408 | 百万円<br>—           | %<br>—        | 百万円<br>931 | 百万円<br>16          | %<br>1.7      |

<外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド>

該当事項はございません。

<外国株式為替ヘッジ型マザーファンド>

| 区 分    | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|        |                |                    |               |                |                    |               |
| 為替先物取引 | 百万円<br>619,316 | 百万円<br>233         | %<br>0.0      | 百万円<br>641,183 | 百万円<br>221         | %<br>0.0      |
| 為替直物取引 | 18,256         | —                  | —             | 9,796          | 12                 | 0.1           |

平均保有割合 1.4%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分    | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|        |               |                    |               |               |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>20,973 | 百万円<br>4,282       | %<br>20.4     | 百万円<br>13,036 | 百万円<br>4,506       | %<br>34.6     |

平均保有割合 1.7%

<野村グローバル株IPストラテジー マザーファンド>

該当事項はございません。

<野村エマージング株IPストラテジー マザーファンド>

| 区 分    | 買付額等<br>A  | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C  | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|------------|--------------------|---------------|------------|--------------------|---------------|
|        |            |                    |               |            |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>173 | 百万円<br>4           | %<br>2.3      | 百万円<br>649 | 百万円<br>4           | %<br>0.6      |

平均保有割合 55.0%

<野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ マザーファンド>

該当事項はございません。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目              | 当 期     |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 2,167千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 5千円     |
| (B) / (A)        | 0.2%    |

\*売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンド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。

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野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2020年3月31日～2021年3月29日)

| 期首残高<br>(元 本) | 当期設定<br>元 本 | 当期解約<br>元 本 | 期末残高<br>(元 本) | 取 引 の 理 由        |
|---------------|-------------|-------------|---------------|------------------|
| 百万円<br>1      | 百万円<br>-    | 百万円<br>1    | 百万円<br>-      | 当初設定時における取得とその処分 |

○組入資産の明細

(2021年3月29日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

2021年3月29日現在の組入れはございません。

| 銘  | 柄 | 期首(前期末) |             |
|--|---|---------|-------------|
|  |   | 口       | 数           |
| NEXT FUNDS NASDAQ-100 <sup>®</sup> 連動型上場投信 |   |         | 口<br>48,300 |
| 合  | 計 |         | 48,300      |

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| 銘      | 柄          | 期首(前期末) |        | 当 期 末 |         | 比 率 |
|--------|------------|---------|--------|-------|---------|-----|
|        |            | 口       | 数      | 評 価 額 |         |     |
|        |            |         |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |     |
| (アメリカ) |            | 口       | 口      | 千米ドル  | 千円      | %   |
| インバスコ  | QQQ信託シリーズ1 | 8,400   | 14,100 | 4,455 | 488,467 | 4.0 |
| 合      | 計          | 8,400   | 14,100 | 4,455 | 488,467 | 4.0 |

\*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により邦貨換算したものです。

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*金額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

| 銘 柄                            | 期首(前期末)   | 当 期 末     |           |
|--------------------------------|-----------|-----------|-----------|
|                                | 口 数       | 口 数       | 評 価 額     |
|                                | 千口        | 千口        | 千円        |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド        | 1,235,683 | 1,857,341 | 6,964,658 |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド              | 268,844   | 237,041   | 601,683   |
| 新興国株式マザーファンド                   | —         | 1,014,421 | 1,634,942 |
| 野村グローバル株IPストラテジー マザーファンド       | 1,149,755 | 876,042   | 1,964,174 |
| 野村エマージング株IPストラテジー マザーファンド      | 531,138   | —         | —         |
| 野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ マザーファンド | 424,591   | 242,879   | 362,399   |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年3月29日現在)

| 項 目                            | 当 期 末      |       |
|--------------------------------|------------|-------|
|                                | 評 価 額      | 比 率   |
|                                | 千円         | %     |
| 投資信託受益証券                       | 488,467    | 4.0   |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド        | 6,964,658  | 57.3  |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド              | 601,683    | 4.9   |
| 新興国株式マザーファンド                   | 1,634,942  | 13.4  |
| 野村グローバル株IPストラテジー マザーファンド       | 1,964,174  | 16.2  |
| 野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ マザーファンド | 362,399    | 3.0   |
| コール・ローン等、その他                   | 145,729    | 1.2   |
| 投資信託財産総額                       | 12,162,052 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（917,387,482千円）の投資信託財産総額（918,627,574千円）に対する比率は99.9%です。

\*外国株式為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（72,799,547千円）の投資信託財産総額（73,968,302千円）に対する比率は98.4%です。

\*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（63,323,987千円）の投資信託財産総額（63,400,769千円）に対する比率は99.9%です。

\*野村グローバル株IPストラテジー マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（1,914,516千円）の投資信託財産総額（2,071,145千円）に対する比率は92.4%です。

\*野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（1,788,560千円）の投資信託財産総額（1,813,993千円）に対する比率は98.6%です。

\*当期末における外貨建て純資産（491,217千円）の投資信託財産総額（12,162,052千円）に対する比率は4.0%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=29.89円、1米ドル=109.63円、1カナダドル=86.97円、1英ポンド=151.02円、1スイスフラン=116.62円、1スウェーデンクローナ=12.66円、1ノルウェークローナ=12.75円、1デンマーククローナ=17.36円、1トルコリラ=13.54円、1ユーロ=129.11円、1チェココルナ=4.96円、1フォリント=0.3561円、1ズロチ=27.86円、1香港ドル=14.11円、1シンガポールドル=81.44円、1リンギ=26.44円、1バーツ=3.51円、1フィリピンペソ=2.26円、1ルピア=0.0076円、1ウォン=0.097円、1新台幣ドル=3.83円、1豪ドル=83.55円、1ニュージーランドドル=76.51円、1インドルピー=1.52円、1新シケル=32.92円、1パキスタンルピー=0.71円、1メキシコペソ=5.31円、1レアル=19.05円、1チリペソ=0.1503円、1コロンビアペソ=0.0297円、1UAEディルハム=29.82円、1エジプトポンド=6.98円、1ランド=7.31円、1クウェートディナール=363.49円、1サウジアラビアリヤル=29.27円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年3月29日現在）

| 項 目                                 | 当 期 末          | 円 |
|-------------------------------------|----------------|---|
| (A) 資産                              | 12,162,052,928 |   |
| コール・ローン等                            | 145,052,969    |   |
| 投資信託受益証券(評価額)                       | 488,467,428    |   |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)        | 6,964,658,335  |   |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)              | 601,683,426    |   |
| 新興国株式マザーファンド(評価額)                   | 1,634,942,438  |   |
| 野村グローバル株IPストラテジー マザーファンド(評価額)       | 1,964,174,815  |   |
| 野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ マザーファンド(評価額) | 362,399,824    |   |
| 未収配当金                               | 673,693        |   |
| (B) 負債                              | 70,590,283     |   |
| 未払収益分配金                             | 3,519,797      |   |
| 未払解約金                               | 39,315,399     |   |
| 未払信託報酬                              | 27,589,537     |   |
| 未払利息                                | 75             |   |
| その他未払費用                             | 165,475        |   |
| (C) 純資産総額(A-B)                      | 12,091,462,645 |   |
| 元本                                  | 7,039,594,070  |   |
| 次期繰越損益金                             | 5,051,868,575  |   |
| (D) 受益権総口数                          | 7,039,594,070口 |   |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                     | 17,176円        |   |

(注) 期首元本額は5,894,122,054円、期中追加設定元本額は3,419,494,620円、期中一部解約元本額は2,274,022,604円、1口当たり純資産額は17,176円です。

## ○損益の状況（2020年3月31日～2021年3月29日）

| 項 目              | 当 期              | 円 |
|------------------|------------------|---|
| (A) 配当等収益        | 3,105,633        |   |
| 受取配当金            | 3,123,562        |   |
| 受取利息             | 193              |   |
| 支払利息             | △ 18,122         |   |
| (B) 有価証券売買損益     | 3,193,942,022    |   |
| 売買益              | 3,784,632,965    |   |
| 売買損              | △ 590,690,943    |   |
| (C) 信託報酬等        | △ 49,960,184     |   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,147,087,471    |   |
| (E) 前期繰越損益金      | △ 647,320,364    |   |
| (F) 追加信託差損益金     | 2,555,621,265    |   |
| (配当等相当額)         | ( 437,314,357)   |   |
| (売買損益相当額)        | ( 2,118,306,908) |   |
| (G) 計(D+E+F)     | 5,055,388,372    |   |
| (H) 収益分配金        | △ 3,519,797      |   |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 5,051,868,575    |   |
| 追加信託差損益金         | 2,555,621,265    |   |
| (配当等相当額)         | ( 443,917,155)   |   |
| (売買損益相当額)        | ( 2,111,704,110) |   |
| 分配準備積立金          | 2,496,247,310    |   |

\*損益の状況の中で(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。

\*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

\*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、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をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2020年3月31日～2021年3月29日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                       |
|------------------------------|---------------------------|
|                              | 2020年3月31日～<br>2021年3月29日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 143,785,151円              |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 2,245,151,003円            |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 2,555,621,265円            |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 110,830,953円              |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 5,055,388,372円            |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 7,181円                    |
| g. 分配金                       | 3,519,797円                |
| h. 分配金(1万口当たり)               | 5円                        |

## ○分配金のお知らせ

|                |    |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

## 運用報告書

第18期（決算日2020年3月31日）

作成対象期間（2019年4月2日～2020年3月31日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 外国の株式を主要投資対象とします。   |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。              |

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○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>証券組入比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|--------|-------|--------------------------------------|-------|------------|------------|----------------|-----------|
|                 | 円      | 騰落率   | MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・<br>為替ヘッジなし) | 騰落率   |            |            |                |           |
| 14期(2016年3月31日) | 20,145 | △ 9.6 | 214.69                               | △ 9.2 | 94.8       | 2.5        | 2.7            | 326,431   |
| 15期(2017年3月31日) | 23,082 | 14.6  | 246.86                               | 15.0  | 95.0       | 2.4        | 2.5            | 364,352   |
| 16期(2018年4月2日)  | 24,752 | 7.2   | 265.15                               | 7.4   | 95.6       | 1.9        | 2.3            | 454,743   |
| 17期(2019年4月1日)  | 27,269 | 10.2  | 293.26                               | 10.6  | 95.6       | 1.7        | 2.6            | 566,435   |
| 18期(2020年3月31日) | 24,094 | △11.6 | 260.14                               | △11.3 | 95.8       | 1.5        | 2.7            | 556,023   |

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに、営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。(以下同じ)

\*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

## ○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                               |       | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券組入比率 |
|--------------------|--------|-------|--------------------------------------|-------|------------|------------|----------------|
|                    | 円      | 騰落率   | MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・<br>為替ヘッジなし) | 騰落率   |            |            |                |
| (期首)<br>2019年4月1日  | 27,269 | —     | 293.26                               | —     | 95.6       | 1.7        | 2.6            |
| 4月末                | 28,277 | 3.7   | 304.29                               | 3.8   | 96.4       | 1.0        | 2.6            |
| 5月末                | 26,495 | △ 2.8 | 285.11                               | △ 2.8 | 95.7       | 1.6        | 2.7            |
| 6月末                | 27,450 | 0.7   | 295.47                               | 0.8   | 95.5       | 1.8        | 2.6            |
| 7月末                | 28,200 | 3.4   | 303.50                               | 3.5   | 95.8       | 1.3        | 2.6            |
| 8月末                | 26,799 | △ 1.7 | 288.66                               | △ 1.6 | 95.7       | 1.4        | 2.8            |
| 9月末                | 27,658 | 1.4   | 297.96                               | 1.6   | 96.1       | 1.0        | 2.8            |
| 10月末               | 28,756 | 5.5   | 309.47                               | 5.5   | 95.9       | 1.3        | 2.8            |
| 11月末               | 29,826 | 9.4   | 321.33                               | 9.6   | 95.7       | 1.5        | 2.7            |
| 12月末               | 30,730 | 12.7  | 331.01                               | 12.9  | 95.8       | 1.5        | 2.7            |
| 2020年1月末           | 30,768 | 12.8  | 331.59                               | 13.1  | 95.5       | 1.7        | 2.7            |
| 2月末                | 28,354 | 4.0   | 305.63                               | 4.2   | 95.8       | 1.3        | 2.8            |
| (期末)<br>2020年3月31日 | 24,094 | △11.6 | 260.14                               | △11.3 | 95.8       | 1.5        | 2.7            |

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首27,269円から期末24,094円に3,175円の値下がりとなりました。

中国発の新型肺炎の世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて、基準価額は下落しました。

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測の高まりなどを巡り一進一退となりましたが、2019年10月以降は、堅調な米企業の決算や市場予想を上回る米国の経済指標の発表、米中貿易協議の進展への期待などから上昇しました。2020年2月下旬には、中国発の新型肺炎の世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まる中、下落に転じました。その後も、新型肺炎の世界的な感染拡大に歯止めがかからず、世界景気の先行き懸念が強まったことや、OPEC（石油輸出国機構）とロシアなど非加盟産油国の減産交渉決裂を受けた原油価格の急落などを受けて、一段と下落しました。

為替市場は、期首から米中貿易摩擦への警戒感から投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、米利下げ観測が高まったことなどをを受けて主要通貨は対円で下落（円高）しました。2019年6月以降は、米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測を巡り一進一退となりましたが、8月上旬には、米大統領による対中追加関税の発動表明を受けて下落（円高）しました。9月以降は、米中貿易協議の進展への期待などをを受け投資家のリスク回避姿勢が和らぐ中、一進一退を繰り返しながら上昇（円安）しました。2020年2月下旬から3月にかけては、新型肺炎の世界的な感染拡大に対する警戒感などから一時的に大きく下落（円高）する場面もありました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流入入に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-11.6%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の-11.3%を0.3ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

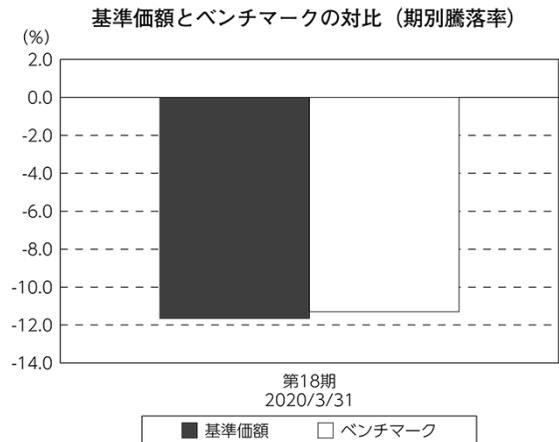
### （その他、差異を生じた要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年4月2日～2020年3月31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)                 | 1   | 0.002   |  |
| (投資信託証券)              | (0) | (0.001) |  |
| (先物・オプション)            | (0) | (0.001) |  |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2   | 0.008   | (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)                 | (2) | (0.008) |  |
| (投資信託証券)              | (0) | (0.000) |  |
| (c) そ の 他 費 用         | 3   | 0.010   | (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><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><br>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (3) | (0.009) |  |
| (そ の 他)               | (0) | (0.000) |  |
| 合 計                   | 6   | 0.020   |  |
| 期中の平均基準価額は、28,483円です。 |     |         |  |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2019年4月2日～2020年3月31日)

## 株式

|        |                    | 買 付                      |                                    | 売 付                      |                                    |
|--------|--------------------|--------------------------|------------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|        |                    | 株 数                      | 金 額                                | 株 数                      | 金 額                                |
| 外 国    | アメリカ               | 百株<br>79,777<br>( 9,263) | 千米ドル<br>641,771<br>( 35,140)       | 百株<br>27,997<br>( 8,405) | 千米ドル<br>198,584<br>( 47,724)       |
|        | カナダ                | 12,595<br>( 109)         | 千カナダドル<br>52,239<br>( 3,059)       | 5,978<br>( 2,246)        | 千カナダドル<br>14,214<br>( 5,445)       |
|        | イギリス               | 76,298<br>(289,640)      | 千英ポンド<br>46,418<br>( 551)          | 21,076<br>(286,677)      | 千英ポンド<br>12,519<br>( 1,427)        |
|        | スイス                | 4,433<br>( 592)          | 千スイスフラン<br>31,526<br>(△ 793)       | 1,247                    | 千スイスフラン<br>9,128                   |
|        | スウェーデン             | 5,916<br>( 1,740)        | 千スウェーデンクローナ<br>83,865<br>( 17,719) | 2,310<br>( 700)          | 千スウェーデンクローナ<br>23,975<br>( 17,719) |
|        | ノルウェー              | 1,289<br>( 129)          | 千ノルウェークローネ<br>17,555<br>( -)       | 669                      | 千ノルウェークローネ<br>10,486               |
|        | デンマーク              | 962<br>( 28)             | 千デンマーククローネ<br>46,598<br>( -)       | 364                      | 千デンマーククローネ<br>15,937               |
|        | ユーロ                |                          | 千ユーロ                               |                          | 千ユーロ                               |
|        | ドイツ                | 6,566<br>( 95)           | 26,839<br>(△ 333)                  | 1,927<br>( 59)           | 8,324<br>( 271)                    |
|        | イタリア               | 13,204                   | 7,480                              | 5,178                    | 2,028                              |
|        | フランス               | 7,145<br>( 120)          | 32,504<br>(△ 20)                   | 2,040                    | 9,026                              |
|        | オランダ               | 5,950                    | 17,633                             | 534                      | 3,393                              |
|        | スペイン               | 11,899<br>( 24,179)      | 9,106<br>( 854)                    | 3,328<br>( 23,448)       | 2,614<br>( 622)                    |
|        | ベルギー               | 512                      | 3,812                              | 81                       | 648                                |
|        | オーストリア             | 218<br>( -)              | 673<br>(△ 56)                      | 58                       | 223                                |
|        | ルクセンブルグ            | 782                      | 742                                | 54                       | 228                                |
| フィンランド | 2,142<br>( 413)    | 3,096<br>( -)            | 467                                | 735                      |                                    |
| アイルランド | 300                | 1,311                    | 102                                | 521                      |                                    |
| ポルトガル  | 620                | 540                      | 150                                | 217                      |                                    |
| 香港     | 24,871<br>( 1,426) | 千香港ドル<br>91,240<br>( -)  | 11,229                             | 千香港ドル<br>31,614          |                                    |

|   |          | 買 付                |                            | 売 付               |                            |
|---|----------|--------------------|----------------------------|-------------------|----------------------------|
|   |          | 株 数                | 金 額                        | 株 数               | 金 額                        |
| 外 | シンガポール   | 百株<br>8,940        | 千シンガポールドル<br>5,481         | 百株<br>11,890      | 千シンガポールドル<br>1,646         |
|   | オーストラリア  | 20,306<br>( 1,903) | 千豪ドル<br>34,833<br>( 2,517) | 5,798<br>( 1,903) | 千豪ドル<br>10,804<br>( 2,622) |
| 国 | ニュージーランド | 2,713              | 千ニュージーランドドル<br>1,553       | —                 | 千ニュージーランドドル<br>—           |
|   | イスラエル    | 2,988<br>( 82)     | 千新シエケル<br>6,260<br>( —)    | 3,081             | 千新シエケル<br>1,711            |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 投資信託証券

| 銘柄                                   | 買付         |           | 売付     |      |
|--------------------------------------|------------|-----------|--------|------|
|                                      | 口数         | 金額        | 口数     | 金額   |
| アメリカ                                 | 口          | 千米ドル      | 口      | 千米ドル |
| AGNC INVESTMENT CORP                 | 9,000      | 140       | —      | —    |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT         | 3,500      | 503       | —      | —    |
| AMERICAN TOWER CORP                  | 12,600     | 2,768     | 3,400  | 760  |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT            | 18,000     | 158       | —      | —    |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC            | 4,100      | 804       | 1,400  | 288  |
| BOSTON PROPERTIES                    | 5,200      | 639       | 1,200  | 167  |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | —          | —         | 15,000 | 292  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST                | 1,400      | 153       | —      | —    |
| CROWN CASTLE INTL CORP               | 10,000     | 1,414     | 2,300  | 326  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC             | 12,900     | 1,680     | —      | —    |
| DUKE REALTY CORP                     | 8,800      | 288       | —      | —    |
| EQUINIX INC                          | 2,320      | 1,297     | —      | —    |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES          | 14,400     | 1,617     | —      | —    |
|                                      | ( 12,100)  | ( —)      |        |      |
| EQUITY RESIDENTIAL                   | 10,300     | 783       | 3,900  | 310  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC             | 1,040      | 319       | —      | —    |
| EXTRA SPACE STORAGE INC              | 2,800      | 300       | —      | —    |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST            | 1,300      | 168       | —      | —    |
| HCP INC                              | 4,400      | 157       | —      | —    |
|                                      | (△ 70,500) | (△ 2,226) |        |      |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC            | 5,200      | 167       | —      | —    |
|                                      | ( 70,500)  | ( 2,226)  |        |      |
| HOST HOTELS & RESORTS INC            | 9,000      | 142       | —      | —    |
| INVITATION HOMES INC                 | 40,000     | 1,052     | —      | —    |
| IRON MOUNTAIN INC                    | 4,800      | 156       | —      | —    |
| KIMCO REALTY CORP                    | 7,000      | 146       | —      | —    |
| LIBERTY PROPERTY TRUST               | 2,600      | 137       | —      | —    |
|                                      | (△ 22,400) | (△ 1,096) |        |      |
| MACERICH CO /THE                     | 4,300      | 139       | 18,500 | 494  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC         | 83,000     | 1,670     | —      | —    |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM           | 2,600      | 327       | —      | —    |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC       | 5,900      | 236       | —      | —    |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS           | 32,200     | 1,354     | —      | —    |
| PROLOGIS INC                         | 16,780     | 1,374     | 3,700  | 320  |
|                                      | ( 15,120)  | ( 1,096)  |        |      |
| PUBLIC STORAGE                       | 3,000      | 687       | —      | —    |
| REALTY INCOME CORP                   | 10,600     | 780       | —      | —    |
| REGENCY CENTERS CORP                 | 5,200      | 320       | —      | —    |
| SBA COMMUNICATIONS CORP              | 2,570      | 649       | —      | —    |
| SIMON PROPERTY GROUP INC             | 7,800      | 944       | 2,200  | 329  |
| SUN COMMUNITIES INC                  | 14,300     | 1,861     | —      | —    |
| UDR INC                              | 9,600      | 396       | —      | —    |
| VENTAS INC                           | 7,600      | 502       | —      | —    |
| VEREIT INC                           | 35,000     | 330       | —      | —    |
| VICI PROPERTIES INC                  | 68,000     | 1,672     | —      | —    |
| VORNADO REALTY TRUST                 | 2,800      | 135       | —      | —    |
| WP CAREY INC                         | 5,900      | 424       | —      | —    |
| WELLTOWER INC                        | 13,500     | 1,073     | 2,100  | 173  |

| 銘柄                                   | 買付額                   |                 | 売付額                 |              |
|--------------------------------------|-----------------------|-----------------|---------------------|--------------|
|                                      | 口数                    | 金額              | 口数                  | 金額           |
| アメリカ                                 | 口                     | 千米ドル            | 口                   | 千米ドル         |
| WEYERHAEUSER CO                      | 20,000                | 511             | 5,500               | 165          |
| 小計                                   | 541,310<br>( 4,820)   | 30,390<br>( —)  | 59,200              | 3,630        |
| カナダ                                  |                       | 千カナダドル          |                     | 千カナダドル       |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA         | 11,500                | 629             | —                   | —            |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | —                     | —               | 9,000               | 188          |
| 小計                                   | 11,500<br>( 25,000)   | 629<br>( 535)   | 9,000               | 188          |
| イギリス                                 |                       | 千英ポンド           |                     | 千英ポンド        |
| HAMMERSON PLC                        | —                     | —               | 108,000             | 300          |
| SEGRO PLC                            | 31,000                | 238             | —                   | —            |
| LAND SECURITIES GROUP PLC            | 12,000                | 91              | —                   | —            |
| 小計                                   | 43,000                | 329             | 108,000             | 300          |
| ユーロ                                  |                       | 千ユーロ            |                     | 千ユーロ         |
| フランス                                 |                       |                 |                     |              |
| ICADE                                | 1,400                 | 98              | 1,300               | 121          |
| KLEPTERRE                            | 4,300                 | 88              | —                   | —            |
| GECTINA SA                           | 700                   | 121             | —                   | —            |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD            | 2,300                 | 243             | —                   | —            |
| 小計                                   | 8,700                 | 551             | 1,300               | 121          |
| ユーロ計                                 | 8,700                 | 551             | 1,300               | 121          |
| 香港                                   |                       | 千香港ドル           |                     | 千香港ドル        |
| LINK REIT                            | 55,000                | 4,384           | 13,000              | 1,056        |
| 小計                                   | 55,000                | 4,384           | 13,000              | 1,056        |
| 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 MALL TRUST                | 70,000                | 178             | 60,000              | 146          |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT         | —                     | —               | —                   | —            |
| ASCENDAS REAL ESTATE-RTS             | —                     | —               | —                   | —            |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST          | ( 60,800)             | ( 170)          | ( 60,800)           | ( 20)        |
| SUNTEC REIT                          | 70,000                | 138             | —                   | —            |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST           | —                     | —               | —                   | —            |
|                                      | ( —)                  | (△ 2)           | —                   | —            |
|                                      | 370,000               | 845             | —                   | —            |
|                                      | ( —)                  | (△ 0.09)        | —                   | —            |
| 小計                                   | 510,000<br>( 121,600) | 1,162<br>( 327) | 60,000<br>( 60,800) | 146<br>( 20) |
| オーストラリア                              |                       | 千豪ドル            |                     | 千豪ドル         |
| MIRVAC GROUP                         | 170,000               | 433             | —                   | —            |
| GPT GROUP                            | 29,000                | 178             | —                   | —            |
| LENDLEASE GROUP                      | 11,000                | 195             | —                   | —            |
| DEXUS                                | 31,000                | 390             | —                   | —            |
| GOODMAN GROUP                        | 27,000                | 378             | —                   | —            |
| SCENTRE GROUP                        | 147,000               | 330             | —                   | —            |
| VICINITY CENTRES                     | 60,000                | 159             | 70,000              | 171          |
| 小計                                   | 475,000               | 2,067           | 70,000              | 171          |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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>104,098 | 百万円<br>105,073 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

\*単位未満は切り捨て。

\*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

(2019年4月2日～2020年3月31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       | 133,290,598千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 580,156,228千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.22          |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年4月2日～2020年3月31日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     |           |                    |               |           |                    |               |

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2020年3月31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                    | 1,053   | 1,147  | 4,159   | 452,626    | 保険                      |
| AES CORP                     | 910     | 1,010  | 1,379   | 150,148    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AT & T INC                   | 9,938   | 11,424 | 34,534  | 3,758,417  | 各種電気通信サービス              |
| ABBOTT LABORATORIES          | 2,396   | 2,768  | 21,961  | 2,390,049  | ヘルスケア機器・用品              |
| ABBVIE INC                   | 2,059   | 2,316  | 17,425  | 1,896,426  | バイオテクノロジー               |
| ABIOMED INC                  | 58      | 72     | 1,072   | 116,744    | ヘルスケア機器・用品              |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 1,004   | 1,208  | 7,063   | 768,685    | 娯楽                      |
| ACUITY BRANDS INC            | 50      | 62     | 531     | 57,866     | 電気設備                    |
| ADOBE INC                    | 665     | 757    | 24,121  | 2,625,113  | ソフトウェア                  |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 99      | 109    | 1,051   | 114,472    | 専門小売り                   |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 1,260   | 1,663  | 7,959   | 866,190    | 半導体・半導体製造装置             |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 75      | —      | —       | —          | 資本市場                    |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 444     | 490    | 3,560   | 387,525    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AIR PRODUCTS                 | 304     | 347    | 7,166   | 779,940    | 化学                      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          | 225     | 258    | 2,430   | 264,468    | 情報技術サービス                |
| ALBEMARLE CORP               | 148     | 167    | 928     | 101,050    | 化学                      |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 307     | 342    | 2,984   | 324,780    | バイオテクノロジー               |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 102     | 118    | 2,123   | 231,052    | ヘルスケア機器・用品              |
| ALLEGHANY CORP               | 21      | 23     | 1,300   | 141,574    | 保険                      |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 66      | 66     | 226     | 24,636     | 情報技術サービス                |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 310     | 376    | 1,901   | 206,932    | 電力                      |
| ALLSTATE CORP                | 466     | 506    | 4,788   | 521,163    | 保険                      |
| ALLY FINANCIAL INC           | 574     | 574    | 879     | 95,701     | 消費者金融                   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 127     | 175    | 1,904   | 207,269    | バイオテクノロジー               |
| ALPHABET INC-CL C            | 429     | 483    | 55,425  | 6,031,990  | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALPHABET INC-CL A            | 408     | 468    | 53,693  | 5,843,426  | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALTICE USA INC-A             | 470     | 200    | 458     | 49,865     | メディア                    |
| ALTRIA GROUP INC             | 2,561   | 2,931  | 10,935  | 1,190,117  | タバコ                     |
| AMAZON.COM INC               | 568     | 658    | 129,306 | 14,072,422 | インターネット販売・通信販売          |
| AMERCO                       | 11      | 11     | 346     | 37,687     | 陸運・鉄道                   |
| AMEREN CORPORATION           | 328     | 391    | 3,056   | 332,633    | 総合公益事業                  |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 146     | 146    | 178     | 19,464     | 旅客航空輸送業                 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 683     | 777    | 6,504   | 707,859    | 電力                      |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 999     | 1,079  | 9,740   | 1,060,018  | 消費者金融                   |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 108     | 125    | 894     | 97,348     | 保険                      |
| AMERICAN INTL GROUP          | 1,198   | 1,378  | 3,542   | 385,567    | 保険                      |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 247     | 283    | 3,586   | 390,283    | 水道                      |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 220     | 239    | 2,105   | 229,151    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 192     | 203    | 2,215   | 241,139    | 資本市場                    |
| AMETEK INC                   | 318     | 355    | 2,617   | 284,814    | 電気設備                    |
| AMGEN INC                    | 872     | 930    | 19,388  | 2,110,065  | バイオテクノロジー               |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 413     | 464    | 3,518   | 382,919    | 電子装置・機器・部品              |
| ANADARKO PETE                | 678     | —      | —       | —          | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ANALOG DEVICES INC           | 510     | 581    | 5,285   | 575,205    | 半導体・半導体製造装置             |
| ANSYS INC                    | 115     | 134    | 3,150   | 342,895    | ソフトウェア                  |
| ANTHEM INC                   | 354     | 394    | 9,084   | 988,704    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APACHE CORPORATION           | 541     | 541    | 222     | 24,198     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| APPLE INC                    | 6,488   | 6,940  | 176,855 | 19,247,235 | コンピュータ・周辺機器             |

| 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        |                         |
| APPLIED MATERIALS                  | 1,363   | 1,436  | 6,792  | 739,203   | 半導体・半導体製造装置             |
| ARAMARK                            | 354     | 410    | 864    | 94,104    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARCHER DANIELS MIDLAND             | 755     | 884    | 3,167  | 344,705   | 食品                      |
| ARCONIC INC                        | 570     | 570    | 934    | 101,734   | 航空宇宙・防衛                 |
| ARISTA NETWORKS INC                | 74      | 81     | 1,666  | 181,355   | 通信機器                    |
| ARROW ELECTRS INC                  | 121     | 121    | 650    | 70,740    | 電子装置・機器・部品              |
| ASSURANT INC                       | 76      | 90     | 965    | 105,126   | 保険                      |
| ATMOS ENERGY CORP                  | 156     | 184    | 1,891  | 205,894   | ガス                      |
| AUTODESK INC.                      | 300     | 342    | 5,332  | 580,294   | ソフトウェア                  |
| AUTOLIV INC                        | 119     | 119    | 555    | 60,505    | 自動車部品                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESS             | 595     | 679    | 9,357  | 1,018,428 | 情報技術サービス                |
| AUTOZONE                           | 34      | 36     | 3,216  | 350,028   | 専門小売り                   |
| AVERY DENNISON CORP                | 122     | 134    | 1,403  | 152,788   | 容器・包装                   |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC         | 310     | —      | —      | —         | 各種金融サービス                |
| BB&T CORPORATION                   | 1,049   | —      | —      | —         | 銀行                      |
| BAKER HUGHES CO                    | 681     | 1,010  | 1,106  | 120,470   | エネルギー設備・サービス            |
| BALL CORP                          | 454     | 475    | 3,134  | 341,130   | 容器・包装                   |
| BANK OF AMERICA CORP               | 12,735  | 13,370 | 29,467 | 3,206,945 | 銀行                      |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP        | 1,368   | 1,279  | 4,348  | 473,258   | 資本市場                    |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.          | 696     | 755    | 6,205  | 675,327   | ヘルスケア機器・用品              |
| BECTON, DICKINSON                  | 369     | 420    | 9,360  | 1,018,707 | ヘルスケア機器・用品              |
| BEIGENE, LTD ADR                   | 46      | 63     | 789    | 85,971    | バイオテクノロジー               |
| WR BERKLEY CORP                    | 130     | 217    | 1,182  | 128,731   | 保険                      |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B        | 1,768   | 2,055  | 37,643 | 4,096,741 | 各種金融サービス                |
| BEST BUY COMPANY INC               | 338     | 363    | 2,168  | 236,044   | 専門小売り                   |
| BIO-RAD LABORATORIES-A             | —       | 36     | 1,270  | 138,296   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        | 241     | 280    | 2,309  | 251,366   | バイオテクノロジー               |
| BIOGEN INC                         | 275     | 283    | 8,959  | 975,021   | バイオテクノロジー               |
| BLACK KNIGHT INC                   | —       | 242    | 1,426  | 155,255   | 情報技術サービス                |
| BLACKROCK INC                      | 161     | 181    | 8,282  | 901,418   | 資本市場                    |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A         | —       | 1,040  | 4,917  | 535,130   | 資本市場                    |
| H & R BLOCK INC                    | 279     | —      | —      | —         | 各種消費者サービス               |
| BOEING CO                          | 739     | 838    | 12,761 | 1,388,786 | 航空宇宙・防衛                 |
| BOOKING HOLDINGS INC               | 63      | 65     | 8,503  | 925,435   | インターネット販売・通信販売          |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS       | —       | 226    | 1,610  | 175,317   | 情報技術サービス                |
| BORGWARNER INC                     | 296     | 296    | 727    | 79,181    | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP             | 1,891   | 2,193  | 6,938  | 755,133   | ヘルスケア機器・用品              |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC          | 139     | —      | —      | —         | 保険                      |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO            | 2,222   | 3,670  | 19,961 | 2,172,369 | 医薬品                     |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 163     | 179    | 1,735  | 188,844   | 情報技術サービス                |
| BROADCOM INC                       | 565     | 622    | 14,934 | 1,625,358 | 半導体・半導体製造装置             |
| BROWN & BROWN INC                  | —       | 388    | 1,447  | 157,503   | 保険                      |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B             | 356     | 478    | 2,706  | 294,593   | 飲料                      |
| BURLINGTON STORES INC              | 89      | 105    | 1,706  | 185,725   | 専門小売り                   |
| CBS CORP-CL B                      | 470     | —      | —      | —         | メディア                    |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC            | 150     | 179    | 1,665  | 181,227   | 資本市場                    |
| CBRE GROUP INC                     | 455     | 483    | 1,981  | 215,673   | 不動産管理・開発                |
| CDK GLOBAL INC                     | 167     | 200    | 683    | 74,330    | ソフトウェア                  |
| CDW CORPORATION                    | 211     | 224    | 2,170  | 236,246   | 電子装置・機器・部品              |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 314     | 353    | 939    | 102,266   | 化学                      |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC         | 183     | 201    | 1,310  | 142,602   | 航空貨物・物流サービス             |
| CIGNA CORP                         | 519     | 580    | 10,339 | 1,125,202 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CIT GROUP INC                      | 134     | —      | —      | —         | 銀行                      |
| CME GROUP INC                      | 488     | 562    | 9,778  | 1,064,165 | 資本市場                    |

| 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        |                         |
| CMS ENERGY CORP               | 378     | 433   | 2,682  | 291,882   | 総合公益事業                  |
| CSX CORP                      | 1,090   | 1,162 | 6,741  | 733,723   | 陸運・鉄道                   |
| CVS HEALTH CORP               | 1,781   | 2,040 | 12,174 | 1,324,974 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CABOT OIL & GAS CORP          | 585     | 640   | 1,120  | 121,959   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CADENCE DESIGN SYS INC        | 378     | 446   | 2,984  | 324,768   | ソフトウェア                  |
| CAMPBELL SOUP CO              | 248     | 248   | 1,153  | 125,583   | 食品                      |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 656     | 723   | 3,894  | 423,871   | 消費者金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC           | 410     | 443   | 2,145  | 233,537   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARMAX INC                    | 239     | 261   | 1,455  | 158,355   | 専門小売り                   |
| CARNIVAL CORP                 | 586     | 621   | 794    | 86,506    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CATERPILLAR INC DEL           | 811     | 868   | 9,696  | 1,055,262 | 機械                      |
| CELANESE CORP-SERIES A        | 180     | 196   | 1,452  | 158,060   | 化学                      |
| CELGENE CORP                  | 962     | —     | —      | —         | バイオテクノロジー               |
| CENTENE CORP                  | 558     | 921   | 5,315  | 578,441   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC        | 704     | 754   | 1,223  | 133,179   | 総合公益事業                  |
| CENTURYLINK INC               | 1,360   | 1,480 | 1,456  | 158,491   | 各種電気通信サービス              |
| CERNER CORP                   | 406     | 499   | 3,205  | 348,862   | ヘルスケア・テクノロジー            |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 217     | 235   | 10,633 | 1,157,287 | メディア                    |
| CHEMOURS CO/THE               | 234     | —     | —      | —         | 化学                      |
| CHENIERE ENERGY INC           | 286     | 364   | 1,184  | 128,904   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHEVRON CORP                  | 2,619   | 2,960 | 21,297 | 2,317,774 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC    | 33      | 41    | 2,636  | 286,949   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CHURCH & DWIGHT CO INC        | 329     | 375   | 2,430  | 264,497   | 家庭用品                    |
| CIMAREX ENERGY CO             | 138     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 216     | 246   | 1,961  | 213,481   | 保険                      |
| CISCO SYSTEMS                 | 6,163   | 6,638 | 26,764 | 2,912,771 | 通信機器                    |
| CINTAS CORP                   | 127     | 134   | 2,418  | 263,154   | 商業サービス・用品               |
| CITIGROUP                     | 3,345   | 3,421 | 15,079 | 1,641,131 | 銀行                      |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP      | 639     | 700   | 1,375  | 149,695   | 銀行                      |
| CITRIX SYSTEMS INC            | 185     | 199   | 2,903  | 315,999   | ソフトウェア                  |
| CLOROX CO                     | 177     | 193   | 3,367  | 366,481   | 家庭用品                    |
| COCA COLA CO                  | 5,520   | 6,368 | 28,656 | 3,118,632 | 飲料                      |
| COGNEX CORP                   | 248     | 278   | 1,263  | 137,538   | 電子装置・機器・部品              |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 804     | 866   | 4,103  | 446,541   | 情報技術サービス                |
| COLGATE PALMOLIVE CO.         | 1,127   | 1,265 | 8,422  | 916,606   | 家庭用品                    |
| COMCAST CORP-CL A             | 6,220   | 7,104 | 25,212 | 2,743,832 | メディア                    |
| COMERICA INC                  | 230     | 230   | 713    | 77,670    | 銀行                      |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC      | 228     | —     | —      | —         | 通信機器                    |
| CONAGRA BRANDS INC            | 667     | 769   | 2,170  | 236,257   | 食品                      |
| CONCHO RESOURCES INC          | 276     | 310   | 1,273  | 138,592   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONOCOPHILLIPS                | 1,586   | 1,710 | 5,008  | 545,084   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONSOLIDATED EDISON INC       | 423     | 525   | 4,238  | 461,256   | 総合公益事業                  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A    | 228     | 259   | 3,792  | 412,769   | 飲料                      |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK  | 139     | 139   | 107    | 11,663    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| THE COOPER COMPANIES, INC.    | 65      | 75    | 2,123  | 231,104   | ヘルスケア機器・用品              |
| COPART INC                    | 279     | 319   | 2,291  | 249,405   | 商業サービス・用品               |
| CORNING INC                   | 1,080   | 1,190 | 2,532  | 275,592   | 電子装置・機器・部品              |
| CORTEVA INC                   | —       | 1,150 | 2,770  | 301,497   | 化学                      |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION  | 597     | 691   | 20,133 | 2,191,167 | 食品・生活必需品小売り             |
| COSTAR GROUP INC              | 51      | 58    | 3,485  | 379,375   | 専門サービス                  |
| COTY INC-CL A                 | 650     | 490   | 265    | 28,849    | パーソナル用品                 |
| CROWN HOLDINGS INC            | 191     | 212   | 1,240  | 135,017   | 容器・包装                   |
| CUMMINS INC                   | 205     | 226   | 3,039  | 330,761   | 機械                      |
| DR HORTON INC                 | 480     | 538   | 1,981  | 215,700   | 家庭用耐久財                  |

| 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    |                         |
| (アメリカ)                            | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                         |
| DTE ENERGY COMPANY                | 251     | 305   | 3,032  | 330,039   | 総合公益事業                  |
| DXC TECHNOLOGY CO                 | 378     | 378   | 545    | 59,402    | 情報技術サービス                |
| DANAHER CORP                      | 860     | 981   | 13,814 | 1,503,425 | ヘルスケア機器・用品              |
| DARDEN RESTAURANTS INC            | 166     | 198   | 1,125  | 122,502   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DAVITA INC                        | 175     | 148   | 1,130  | 123,072   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY                   | 422     | 471   | 6,651  | 723,929   | 機械                      |
| DELL TECHNOLOGIES-C               | 207     | 266   | 1,058  | 115,216   | コンピュータ・周辺機器             |
| DELTA AIR LINES INC               | 224     | 252   | 722    | 78,627    | 旅客航空輸送業                 |
| DENTSPLY SIRONA INC               | 303     | 352   | 1,379  | 150,167   | ヘルスケア機器・用品              |
| DEVON ENERGY CORP                 | 624     | 624   | 396    | 43,122    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DEXCOM INC                        | 116     | 144   | 4,025  | 438,088   | ヘルスケア機器・用品              |
| DIAMONDBACK ENERGY INC            | 216     | 231   | 544    | 59,304    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DISNEY (WALT) CO                  | 2,459   | 2,820 | 28,143 | 3,062,867 | 娯楽                      |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES       | 463     | 496   | 1,864  | 202,909   | 消費者金融                   |
| DISCOVERY INC - A                 | 193     | 245   | 490    | 53,353    | メディア                    |
| DISCOVERY INC - C                 | 398     | 570   | 1,023  | 111,349   | メディア                    |
| DISH NETWORK CORP-A               | 319     | 371   | 769    | 83,699    | メディア                    |
| DOCUSIGN INC                      | —       | 166   | 1,463  | 159,231   | ソフトウェア                  |
| DOLLAR GENERAL CORP               | 361     | 397   | 5,826  | 634,127   | 複合小売り                   |
| DOLLAR TREE INC                   | 324     | 376   | 3,002  | 326,746   | 複合小売り                   |
| DOMINION ENERGY INC               | 1,024   | 1,278 | 9,816  | 1,068,309 | 総合公益事業                  |
| DOMINOS PIZZA INC                 | 52      | 59    | 2,045  | 222,647   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DOVER CORP                        | 197     | 229   | 1,961  | 213,432   | 機械                      |
| DOW INC                           | —       | 1,152 | 3,300  | 359,191   | 化学                      |
| DOWDUPONT INC                     | 3,141   | —     | —      | —         | 化学                      |
| DROPBOX INC-CLASS A               | —       | 390   | 707    | 77,035    | ソフトウェア                  |
| DUKE ENERGY CORP                  | 973     | 1,138 | 9,497  | 1,033,639 | 電力                      |
| DUPONT DE NEMOURS INC             | —       | 1,150 | 3,866  | 420,769   | 化学                      |
| EOG RESOURCES INC                 | 800     | 904   | 3,162  | 344,141   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| E*TRADE FINANCIAL CORP            | 350     | 350   | 1,235  | 134,497   | 資本市場                    |
| EAST WEST BANCORP INC             | 207     | 207   | 556    | 60,577    | 銀行                      |
| EASTMAN CHEMICAL CO.              | 186     | 208   | 990    | 107,773   | 化学                      |
| EATON VANCE CORP                  | 164     | 164   | 553    | 60,290    | 資本市場                    |
| EBAY INC                          | 1,237   | 1,200 | 3,742  | 407,328   | インターネット販売・通信販売          |
| ECOLAB INC                        | 360     | 401   | 6,472  | 704,362   | 化学                      |
| EDISON INTERNATIONAL              | 450     | 555   | 3,125  | 340,116   | 電力                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP         | 284     | 325   | 6,371  | 693,459   | ヘルスケア機器・用品              |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC          | 361     | 600   | 1,355  | 147,508   | 医薬品                     |
| ELECTRONIC ARTS                   | 408     | 461   | 4,503  | 490,116   | 娯楽                      |
| EMERSON ELEC                      | 861     | 938   | 4,373  | 476,010   | 電気設備                    |
| ENTERGY CORP                      | 254     | 313   | 3,132  | 340,876   | 電力                      |
| EPAM SYSTEMS INC                  | —       | 84    | 1,581  | 172,065   | 情報技術サービス                |
| EQUIFAX INC                       | 161     | 185   | 2,258  | 245,830   | 専門サービス                  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC            | —       | 620   | 958    | 104,315   | 各種金融サービス                |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A       | —       | 37    | 645    | 70,201    | 保険                      |
| ESSENTIAL UTILITIES INC           | —       | 349   | 1,502  | 163,511   | 水道                      |
| EVERGY INC                        | 372     | 359   | 2,122  | 230,942   | 電力                      |
| EVERSOURCE ENERGY                 | 442     | 503   | 4,207  | 457,912   | 電力                      |
| EXACT SCIENCES CORP               | —       | 226   | 1,320  | 143,711   | バイオテクノロジー               |
| EXELON CORPORATION                | 1,322   | 1,515 | 5,640  | 613,838   | 電力                      |
| EXPEDIA GROUP INC                 | 173     | 207   | 1,167  | 127,034   | インターネット販売・通信販売          |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 230     | 273   | 1,828  | 198,971   | 航空貨物・物流サービス             |
| EXXON MOBIL CORP                  | 5,784   | 6,621 | 24,828 | 2,702,112 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FLIR SYSTEMS INC                  | 178     | 207   | 665    | 72,404    | 電子装置・機器・部品              |

| 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        |                         |
| FMC CORP                           | 180     | 196    | 1,619  | 176,276   | 化学                      |
| FACEBOOK INC-A                     | 3,283   | 3,761  | 62,413 | 6,792,493 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC       | —       | 59     | 1,586  | 172,710   | 資本市場                    |
| FASTENAL CO                        | 387     | 874    | 2,779  | 302,473   | 商社・流通業                  |
| FEDEX CORPORATION                  | 344     | 391    | 4,860  | 528,970   | 航空貨物・物流サービス             |
| F5 NETWORKS INC                    | 81      | 93     | 1,021  | 111,140   | 通信機器                    |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION      | 451     | 964    | 12,077 | 1,314,443 | 情報技術サービス                |
| FNFG GROUP                         | 372     | 405    | 1,069  | 116,361   | 保険                      |
| FIFTH THIRD BANCORP                | 1,063   | 1,120  | 1,776  | 193,377   | 銀行                      |
| FIRST DATA CORP- CLASS A           | 740     | —      | —      | —         | 情報技術サービス                |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 226     | 257    | 2,220  | 241,654   | 銀行                      |
| FISERV INC                         | 541     | 908    | 8,928  | 971,673   | 情報技術サービス                |
| FIRSTENERGY CORP                   | 714     | 834    | 3,376  | 367,504   | 電力                      |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 121     | 138    | 2,677  | 291,389   | 情報技術サービス                |
| FLUOR CORP                         | 184     | —      | —      | —         | 建設・土木                   |
| FLOWSERVE CORP                     | 172     | 206    | 463    | 50,420    | 機械                      |
| FORD MOTOR COMPANY                 | 5,160   | 6,070  | 3,053  | 332,280   | 自動車                     |
| FORTINET INC                       | 199     | 228    | 2,301  | 250,489   | ソフトウェア                  |
| FORTIVE CORP                       | 406     | 476    | 2,479  | 269,894   | 機械                      |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 194     | 216    | 961    | 104,630   | 建設関連製品                  |
| FOX CORP-CLASS A                   | 480     | 528    | 1,283  | 139,690   | メディア                    |
| FOX CORP-CLASS B                   | 198     | 254    | 603    | 65,706    | メディア                    |
| FRANKLIN RESOURCES INC             | 434     | 434    | 770    | 83,884    | 資本市場                    |
| FREEMPORT-MCMORAN INC              | 1,870   | 2,250  | 1,404  | 152,797   | 金属・鉱業                   |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO            | 249     | 297    | 2,471  | 268,987   | 保険                      |
| GAP INC                            | 315     | 315    | 233    | 25,436    | 専門小売り                   |
| GARTNER INC                        | 127     | 141    | 1,520  | 165,434   | 情報技術サービス                |
| GENERAL DYNAMICS                   | 345     | 383    | 5,116  | 556,870   | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL ELEC CO                    | 11,980  | 13,550 | 10,690 | 1,163,496 | コングロマリット                |
| GENERAL MILLS                      | 805     | 943    | 5,101  | 555,210   | 食品                      |
| GENERAL MOTORS CO                  | 1,757   | 1,990  | 4,242  | 461,730   | 自動車                     |
| GENUINE PARTS CO                   | 196     | 232    | 1,533  | 166,842   | 販売                      |
| GILEAD SCIENCES INC                | 1,762   | 1,982  | 15,049 | 1,637,818 | バイオテクノロジー               |
| GLOBAL PAYMENTS INC                | 212     | 473    | 7,153  | 778,480   | 情報技術サービス                |
| GLOBE LIFE INC                     | —       | 157    | 1,165  | 126,814   | 保険                      |
| GODADDY INC - CLASS A              | 227     | 269    | 1,591  | 173,192   | 情報技術サービス                |
| GOLDMAN SACHS GROUP                | 457     | 501    | 7,996  | 870,309   | 資本市場                    |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO          | 340     | —      | —      | —         | 自動車部品                   |
| GRAINGER(W.W.) INC                 | 64      | 70     | 1,785  | 194,368   | 商社・流通業                  |
| GRUBHUB INC                        | 119     | 145    | 573    | 62,411    | インターネット販売・通信販売          |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC             | —       | 121    | 1,005  | 109,403   | ソフトウェア                  |
| HCA HEALTHCARE INC                 | 375     | 424    | 3,856  | 419,725   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC             | 229     | 268    | 740    | 80,616    | 商社・流通業                  |
| HP INC                             | 2,190   | 2,320  | 4,138  | 450,434   | コンピュータ・周辺機器             |
| HALLIBURTON CO                     | 1,196   | 1,280  | 815    | 88,735    | エネルギー設備・サービス            |
| HANESBRANDS INC                    | 510     | 510    | 411    | 44,735    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| HARLEY-DAVIDSON INC                | 224     | 224    | 401    | 43,685    | 自動車                     |
| HARRIS CORP                        | 160     | —      | —      | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES        | 482     | 545    | 1,953  | 212,575   | 保険                      |
| HASBRO INC                         | 158     | 196    | 1,401  | 152,471   | レジャー用品                  |
| HEICO CORP                         | —       | 63     | 484    | 52,718    | 航空宇宙・防衛                 |
| HEICO CORP-CLASS A                 | —       | 124    | 818    | 89,079    | 航空宇宙・防衛                 |
| HELMERICH & PAYNE                  | 146     | —      | —      | —         | エネルギー設備・サービス            |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC        | 106     | 117    | 1,825  | 198,700   | 情報技術サービス                |

| 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        |                         |
| HERSHEY CO/THE                           | 190     | 235   | 3,237  | 352,373   | 食品                      |
| HESS CORP                                | 366     | 432   | 1,379  | 150,117   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE               | 2,000   | 2,020 | 2,030  | 220,935   | コンピュータ・周辺機器             |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC            | 395     | 416   | 2,857  | 310,936   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HOLLYFRONTIER CORP                       | 236     | 236   | 614    | 66,829    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HOLOGIC INC                              | 408     | 433   | 1,515  | 164,931   | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT                               | 1,548   | 1,706 | 33,454 | 3,640,870 | 専門小売り                   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC              | 1,009   | 1,120 | 14,756 | 1,605,895 | コングロマリット                |
| HORMEL FOODS CORP                        | 391     | 456   | 2,133  | 232,152   | 食品                      |
| HUMANA INC                               | 185     | 204   | 6,377  | 694,020   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC              | 118     | 132   | 1,234  | 134,404   | 陸運・鉄道                   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC                | 1,410   | 1,540 | 1,289  | 140,363   | 銀行                      |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE             | 56      | 65    | 1,232  | 134,079   | 航空宇宙・防衛                 |
| IAC/INTERACTIVE CORP                     | 104     | 126   | 2,268  | 246,840   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| IPG PHOTONICS CORP                       | 47      | 59    | 644    | 70,116    | 電子装置・機器・部品              |
| IDEX CORP                                | 103     | 123   | 1,683  | 183,228   | 機械                      |
| IDEXX LABORATORIES INC                   | 121     | 136   | 3,277  | 356,730   | ヘルスケア機器・用品              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC                  | 405     | 500   | 7,117  | 774,597   | 機械                      |
| ILLUMINA INC                             | 201     | 228   | 6,320  | 687,821   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| INCYTE CORP                              | 249     | 285   | 2,056  | 223,846   | バイオテクノロジー               |
| INGERSOLL-RAND INC                       | —       | 528   | 1,254  | 136,581   | 機械                      |
| INGREDION INC                            | 96      | 96    | 741    | 80,739    | 食品                      |
| INSULET CORP                             | —       | 98    | 1,710  | 186,195   | ヘルスケア機器・用品              |
| INTEL CORP                               | 6,256   | 6,802 | 37,744 | 4,107,711 | 半導体・半導体製造装置             |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC            | 785     | 876   | 7,341  | 799,003   | 資本市場                    |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES          | 1,244   | 1,388 | 15,674 | 1,705,875 | 情報技術サービス                |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE        | 115     | 155   | 1,674  | 182,198   | 化学                      |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)               | 523     | 598   | 1,873  | 203,896   | 容器・包装                   |
| INTERPUBRIC GROUP                        | 500     | 580   | 939    | 102,256   | メディア                    |
| INTUIT INC                               | 337     | 404   | 9,617  | 1,046,642 | ソフトウェア                  |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   | 155     | 181   | 9,151  | 995,967   | ヘルスケア機器・用品              |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC                | —       | 214   | 1,031  | 112,279   | バイオテクノロジー               |
| IQVIA HOLDINGS INC                       | 224     | 252   | 2,847  | 309,849   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| JPMORGAN CHASE & CO                      | 4,544   | 4,903 | 45,843 | 4,989,099 | 銀行                      |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC             | 179     | 200   | 1,559  | 169,753   | 建設・土木                   |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC            | 420     | 430   | 602    | 65,515    | 各種金融サービス                |
| JOHNSON & JOHNSON                        | 3,665   | 4,114 | 54,720 | 5,955,211 | 医薬品                     |
| JONES LANG LASALLE INC                   | 63      | 76    | 816    | 88,864    | 不動産管理・開発                |
| JUNIPER NETWORKS INC                     | 467     | 530   | 1,073  | 116,801   | 通信機器                    |
| KLA CORP                                 | 219     | 244   | 3,648  | 397,043   | 半導体・半導体製造装置             |
| KKR & CO INC-A                           | 680     | 784   | 1,922  | 209,211   | 資本市場                    |
| KANSAS CITY SOUTHERN                     | 142     | 151   | 1,953  | 212,614   | 陸運・鉄道                   |
| KELLOGG CO                               | 356     | 400   | 2,436  | 265,153   | 食品                      |
| KEYCORP                                  | 1,460   | 1,580 | 1,704  | 185,535   | 銀行                      |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC                | 252     | 289   | 2,475  | 269,416   | 電子装置・機器・部品              |
| KIMBERLY-CLARK CORP                      | 469     | 533   | 7,058  | 768,178   | 家庭用品                    |
| KINDER MORGAN INC                        | 2,730   | 3,150 | 4,180  | 454,914   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 167     | 208   | 692    | 75,357    | 陸運・鉄道                   |
| KOHL'S CORP                              | 225     | 253   | 405    | 44,136    | 複合小売り                   |
| KRAFT HEINZ CO/THE                       | 847     | 1,041 | 2,620  | 285,156   | 食品                      |
| KROGER CO                                | 1,076   | 1,269 | 3,762  | 409,482   | 食品・生活必需品小売り             |
| L BRANDS, INC                            | 303     | —     | —      | —         | 専門小売り                   |
| LKQ CORP                                 | 450     | 450   | 945    | 102,844   | 販売                      |
| L3 TECHNOLOGIES INC                      | 109     | —     | —      | —         | 航空宇宙・防衛                 |

| 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         |                         |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | —       | 344    | 6,259   | 681,213    | 航空宇宙・防衛                 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 142     | 149    | 1,966   | 213,965    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH                 | 212     | 224    | 5,718   | 622,368    | 半導体・半導体製造装置             |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 193     | 217    | 1,250   | 136,123    | 食品                      |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 549     | 538    | 2,339   | 254,636    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 299     | 344    | 5,683   | 618,580    | パーソナル用品                 |
| LEAR CORP                    | 93      | 84     | 743     | 80,949     | 自動車部品                   |
| LEGGETT & PLATT INC          | 189     | 189    | 530     | 57,736     | 家庭用耐久財                  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 200     | 215    | 2,008   | 218,611    | 情報技術サービス                |
| LENNAR CORP-A                | 407     | 430    | 1,718   | 187,000    | 家庭用耐久財                  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 51      | 51     | 954     | 103,891    | 建設関連製品                  |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C     | 139     | 167    | 1,904   | 207,263    | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP       | 129     | 129    | 390     | 42,482     | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C       | 224     | 267    | 815     | 88,800     | メディア                    |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 293     | 293    | 778     | 84,756     | 娯楽                      |
| ELI LILLY & CO.              | 1,224   | 1,353  | 18,730  | 2,038,487  | 医薬品                     |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 299     | 299    | 815     | 88,769     | 保険                      |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 208     | 230    | 1,040   | 113,214    | 娯楽                      |
| LOCKHEED MARTIN              | 349     | 397    | 13,880  | 1,510,641  | 航空宇宙・防衛                 |
| LOEWS CORP                   | 361     | 433    | 1,534   | 166,958    | 保険                      |
| LOWES COS INC                | 1,098   | 1,205  | 10,689  | 1,163,344  | 専門小売り                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 138     | 172    | 3,335   | 363,031    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| M & T BANK CORP              | 179     | 200    | 2,138   | 232,678    | 銀行                      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 700     | 790    | 910     | 99,129     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MSCI INC                     | 120     | 131    | 3,865   | 420,666    | 資本市場                    |
| MACYS INC                    | 437     | —      | —       | —          | 複合小売り                   |
| MANPOWERGROUP INC            | 80      | 96     | 529     | 57,650     | 専門サービス                  |
| MARATHON OIL CORP            | 1,110   | 1,230  | 398     | 43,370     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 946     | 985    | 2,396   | 260,811    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARKEL CORP                  | 18      | 21     | 2,017   | 219,519    | 保険                      |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | —       | 58     | 2,051   | 223,287    | 資本市場                    |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 691     | 794    | 7,110   | 773,810    | 保険                      |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA   | 394     | 432    | 3,290   | 358,062    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 89      | 97     | 1,741   | 189,510    | 建設資材                    |
| MASCO CORP                   | 428     | 428    | 1,509   | 164,284    | 建設関連製品                  |
| MASTERCARD INC               | 1,259   | 1,403  | 35,553  | 3,869,316  | 情報技術サービス                |
| MATCH GROUP INC              | —       | 84     | 560     | 60,947     | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| MATTEL INC                   | 480     | —      | —       | —          | レジャー用品                  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 374     | 424    | 2,116   | 230,304    | 半導体・半導体製造装置             |
| MCCORMICK & CO INC.          | 168     | 189    | 2,705   | 294,443    | 食品                      |
| MCDONALD'S CORP              | 1,056   | 1,179  | 19,822  | 2,157,285  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MCKESSON CORP                | 270     | 256    | 3,533   | 384,530    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 340     | 340    | 423     | 46,141     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MERCADOLIBRE INC             | 57      | 69     | 3,270   | 355,921    | インターネット販売・通信販売          |
| MERCK & CO INC               | 3,564   | 3,983  | 30,649  | 3,335,550  | 医薬品                     |
| METLIFE INC                  | 1,159   | 1,206  | 3,862   | 420,390    | 保険                      |
| METTLER-TOLEDO INTL          | 34      | 38     | 2,659   | 289,417    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| MICROSOFT CORP               | 9,970   | 11,321 | 181,396 | 19,741,368 | ソフトウェア                  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 330     | 373    | 2,573   | 280,055    | 半導体・半導体製造装置             |
| MICRON TECHNOLOGY            | 1,545   | 1,740  | 7,746   | 843,049    | 半導体・半導体製造装置             |
| MIDDLEBY CORP                | 75      | 87     | 495     | 53,968     | 機械                      |
| MOHAWK INDUSTRIES            | 87      | 87     | 697     | 75,887     | 家庭用耐久財                  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B   | 256     | 284    | 1,144   | 124,558    | 飲料                      |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC   | 1,985   | 2,259  | 11,550  | 1,257,015  | 食品                      |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当期     |           | 期末  |  | 業種等                |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-----|--|--------------------|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額    |           | 業種等 |  |                    |
|                              |         |       | 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        |     |  |                    |
| MONGODB INC                  | —       | 74    | 1,009  | 109,872   |     |  | 情報技術サービス           |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 559     | 638   | 3,700  | 402,714   |     |  | 飲料                 |
| MOODYS CORP                  | 235     | 268   | 5,955  | 648,136   |     |  | 資本市場               |
| MORGAN STANLEY               | 1,753   | 1,910 | 6,654  | 724,202   |     |  | 資本市場               |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD    | 450     | 450   | 199    | 21,744    |     |  | 食品・生活必需品小売り        |
| MOSAIC CO/THE                | 488     | 560   | 560    | 60,944    |     |  | 化学                 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 221     | 268   | 3,574  | 388,992   |     |  | 通信機器               |
| NRG ENERGY INC               | 400     | 405   | 1,152  | 125,396   |     |  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| NVR INC                      | 4       | 5     | 1,517  | 165,127   |     |  | 家庭用耐久財             |
| NASDAQ INC                   | 154     | 184   | 1,829  | 199,125   |     |  | 資本市場               |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 506     | 580   | 545    | 59,334    |     |  | エネルギー設備・サービス       |
| NEKTAR THERAPEUTICS          | 250     | —     | —      | —         |     |  | 医薬品                |
| NETAPP INC                   | 352     | 352   | 1,433  | 155,990   |     |  | コンピュータ・周辺機器        |
| NETFLIX INC                  | 595     | 685   | 25,440 | 2,768,682 |     |  | 娯楽                 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | —       | 142   | 1,300  | 141,541   |     |  | バイオテクノロジー          |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 1,610   | 1,840 | 697    | 75,893    |     |  | 不動産管理・開発           |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 307     | 354   | 1,663  | 181,071   |     |  | コングロマリット           |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 300     | 333   | 690    | 75,198    |     |  | コングロマリット           |
| NEWELL BRANDS INC            | 670     | 660   | 900    | 97,973    |     |  | 家庭用耐久財             |
| NEWMONT CORP                 | 717     | 1,276 | 5,915  | 643,787   |     |  | 金属・鉱業              |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I       | 550     | 550   | 485    | 52,793    |     |  | メディア               |
| NEXTERA ENERGY INC           | 651     | 765   | 18,819 | 2,048,155 |     |  | 電力                 |
| NIKE INC-B                   | 1,742   | 1,952 | 16,666 | 1,813,779 |     |  | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| NISOURCE INC                 | 476     | 582   | 1,517  | 165,188   |     |  | 総合公益事業             |
| NOBLE ENERGY INC             | 644     | 710   | 377    | 41,029    |     |  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| NORDSTROM INC                | 150     | 150   | 236    | 25,760    |     |  | 複合小売り              |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 371     | 403   | 5,976  | 650,377   |     |  | 陸運・鉄道              |
| NORTHERN TRUST CORP          | 284     | 321   | 2,432  | 264,768   |     |  | 資本市場               |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 223     | 251   | 7,893  | 859,016   |     |  | 航空宇宙・防衛            |
| NORTONLIFELOCK INC           | —       | 980   | 1,871  | 203,707   |     |  | ソフトウェア             |
| NUCOR CORP                   | 427     | 467   | 1,630  | 177,476   |     |  | 金属・鉱業              |
| NVIDIA CORP                  | 796     | 909   | 24,166 | 2,629,989 |     |  | 半導体・半導体製造装置        |
| OGE ENERGY CORP              | 286     | 325   | 1,036  | 112,829   |     |  | 電力                 |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,      | 110     | 119   | 3,808  | 414,504   |     |  | 専門小売り              |
| OCCIDENTAL PETE CORP         | 1,029   | 1,420 | 1,563  | 170,146   |     |  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| OKTA INC                     | —       | 165   | 2,061  | 224,354   |     |  | 情報技術サービス           |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 86      | 153   | 2,060  | 224,238   |     |  | 陸運・鉄道              |
| OMNICOM GROUP                | 303     | 345   | 1,894  | 206,204   |     |  | メディア               |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 590     | 590   | 765    | 83,279    |     |  | 半導体・半導体製造装置        |
| ONEOK INC                    | 560     | 670   | 1,342  | 146,123   |     |  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ORACLE CORPORATION           | 3,631   | 3,598 | 18,119 | 1,971,948 |     |  | ソフトウェア             |
| OWENS CORNING INC            | 142     | 168   | 669    | 72,914    |     |  | 建設関連製品             |
| PNC FINANCIAL                | 627     | 689   | 6,956  | 757,112   |     |  | 銀行                 |
| PPG INDUSTRIES               | 326     | 368   | 3,161  | 344,104   |     |  | 化学                 |
| PPL CORPORATION              | 976     | 1,148 | 2,965  | 322,711   |     |  | 電力                 |
| PVH CORP                     | 99      | 116   | 443    | 48,249    |     |  | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| PTC INC                      | 147     | 170   | 1,007  | 109,656   |     |  | ソフトウェア             |
| PACCAR                       | 478     | 538   | 3,350  | 364,594   |     |  | 機械                 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 132     | 145   | 1,316  | 143,222   |     |  | 容器・包装              |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 126     | 152   | 2,530  | 275,377   |     |  | ソフトウェア             |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 181     | 201   | 2,620  | 285,138   |     |  | 機械                 |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 370     | —     | —      | —         |     |  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PAYCHEX INC                  | 450     | 505   | 3,253  | 354,046   |     |  | 情報技術サービス           |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | —       | 75    | 1,606  | 174,881   |     |  | ソフトウェア             |

| 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        |                         |
| PAYPAL HOLDINGS INC           | 1,526   | 1,747 | 16,951 | 1,844,792 | 情報技術サービス                |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC  | 500     | 710   | 817    | 88,936    | 銀行                      |
| PEPSICO INC                   | 1,926   | 2,182 | 27,379 | 2,979,736 | 飲料                      |
| PERKINELMER INC               | —       | 174   | 1,331  | 144,882   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| PFIZER INC                    | 7,924   | 8,658 | 28,285 | 3,078,331 | 医薬品                     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   | 2,121   | 2,437 | 17,680 | 1,924,161 | タバコ                     |
| PHILLIPS 66                   | 594     | 703   | 3,807  | 414,364   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP    | 154     | 170   | 1,332  | 144,974   | 電力                      |
| PINTEREST INC- CLASS A        | —       | 460   | 709    | 77,195    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  | 232     | 261   | 1,735  | 188,862   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A    | 190     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| POLARIS INC                   | 83      | 83    | 391    | 42,608    | レジャー用品                  |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 324     | 366   | 3,617  | 393,657   | 資本市場                    |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 380     | 444   | 1,474  | 160,472   | 保険                      |
| PROCTER & GAMBLE CO           | 3,403   | 3,899 | 44,838 | 4,879,773 | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CO                | 808     | 920   | 7,008  | 762,741   | 保険                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 572     | 630   | 3,386  | 368,525   | 保険                      |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE         | 695     | 781   | 3,476  | 378,318   | 総合公益事業                  |
| PULTEGROUP INC                | 379     | 379   | 900    | 98,001    | 家庭用耐久財                  |
| QORVO INC                     | 176     | 176   | 1,434  | 156,067   | 半導体・半導体製造装置             |
| QUALCOMM INC                  | 1,655   | 1,791 | 12,363 | 1,345,495 | 半導体・半導体製造装置             |
| QUEST DIAGNOSTICS INC         | 191     | 205   | 1,702  | 185,308   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| QURATE RETAIL INC - A         | 580     | —     | —      | —         | インターネット販売・通信販売          |
| RPM INTERNATIONAL INC         | —       | 211   | 1,289  | 140,304   | 化学                      |
| RALPH LAUREN CORPORATION      | 78      | 78    | 555    | 60,490    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 177     | 196   | 1,262  | 137,369   | 資本市場                    |
| RAYTHEON COMPANY              | 394     | 433   | 6,114  | 665,429   | 航空宇宙・防衛                 |
| RED HAT INC                   | 243     | —     | —      | —         | ソフトウェア                  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 110     | 127   | 6,030  | 656,326   | バイオテクノロジー               |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 1,390   | 1,500 | 1,425  | 155,082   | 銀行                      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 90      | 90    | 782    | 85,135    | 保険                      |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A    | 308     | 343   | 2,629  | 286,124   | 商業サービス・用品               |
| RESMED INC                    | 192     | 225   | 3,469  | 377,610   | ヘルスケア機器・用品              |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A       | —       | 119   | 2,713  | 295,316   | ソフトウェア                  |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 171     | 171   | 689    | 75,016    | 専門サービス                  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 168     | 178   | 2,710  | 294,954   | 電気設備                    |
| ROKU INC                      | —       | 142   | 1,272  | 138,482   | 娯楽                      |
| ROLLINS INC                   | 210     | 239   | 856    | 93,221    | 商業サービス・用品               |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 143     | 164   | 5,209  | 566,951   | コングロマリット                |
| ROSS STORES INC               | 505     | 561   | 4,761  | 518,162   | 専門小売り                   |
| S&P GLOBAL INC                | 344     | 384   | 9,484  | 1,032,188 | 資本市場                    |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 191     | 191   | 887    | 96,532    | 資本市場                    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS    | 306     | 367   | 1,604  | 174,660   | ソフトウェア                  |
| SVB FINANCIAL GROUP           | 74      | 81    | 1,261  | 137,323   | 銀行                      |
| SABRE CORP                    | 360     | 420   | 261    | 28,476    | 情報技術サービス                |
| SALESFORCE.COM INC            | 1,043   | 1,304 | 19,540 | 2,126,586 | ソフトウェア                  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC      | —       | 112   | 1,103  | 120,085   | バイオテクノロジー               |
| HENRY SCHEIN INC              | 205     | 231   | 1,203  | 130,952   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD              | 1,911   | 2,140 | 2,841  | 309,286   | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP         | 1,662   | 1,797 | 6,169  | 671,383   | 資本市場                    |
| SEALED AIR CORP               | 219     | 219   | 563    | 61,324    | 容器・包装                   |
| SEATTLE GENETICS INC          | 154     | 187   | 2,155  | 234,629   | バイオテクノロジー               |
| SEMPRA ENERGY                 | 371     | 436   | 5,231  | 569,351   | 総合公益事業                  |
| SERVICENOW INC                | 248     | 296   | 8,485  | 923,502   | ソフトウェア                  |

| 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        |                      |
| SHERWIN-WILLIAMS                  | 116     | 129   | 6,230  | 678,017   | 化学                   |
| SIGNATURE BANK                    | 76      | 89    | 738    | 80,412    | 銀行                   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC            | 2,290   | 2,290 | 1,101  | 119,875   | メディア                 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC            | 238     | 272   | 2,450  | 266,741   | 半導体・半導体製造装置          |
| SMITH (A. O.) CORP                | 186     | 218   | 841    | 91,578    | 建設関連製品               |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW             | 159     | 174   | 1,924  | 209,493   | 食品                   |
| SNAP-ON INC                       | 74      | 84    | 949    | 103,328   | 機械                   |
| SNAP INC-A                        | —       | 1,170 | 1,386  | 150,887   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SOUTHERN CO.                      | 1,402   | 1,647 | 9,550  | 1,039,430 | 電力                   |
| SOUTHWEST AIRLINES                | 198     | 198   | 694    | 75,634    | 旅客航空輸送業              |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A      | 146     | 146   | 354    | 38,531    | 航空宇宙・防衛              |
| SPLUNK INC                        | 197     | 237   | 3,015  | 328,134   | ソフトウェア               |
| SPRINT CORP                       | 1,090   | 1,290 | 1,088  | 118,489   | 無線通信サービス             |
| SQUARE INC - A                    | 418     | 531   | 2,920  | 317,838   | 情報技術サービス             |
| STANLEY BLACK & DECKER INC        | 211     | 239   | 2,399  | 261,092   | 機械                   |
| STARBUCKS CORP                    | 1,696   | 1,852 | 12,567 | 1,367,739 | ホテル・レストラン・レジャー       |
| STATE STREET CORP                 | 522     | 559   | 2,893  | 314,947   | 資本市場                 |
| STEEL DYNAMICS                    | 334     | 334   | 729    | 79,350    | 金属・鉱業                |
| STRYKER CORP                      | 465     | 529   | 8,620  | 938,178   | ヘルスケア機器・用品           |
| SUNTRUST BKS INC.                 | 607     | —     | —      | —         | 銀行                   |
| SYMANTEC CORP                     | 830     | —     | —      | —         | ソフトウェア               |
| SYNOPSYS INC                      | 207     | 239   | 3,090  | 336,340   | ソフトウェア               |
| SYNCHRONY FINANCIAL               | 872     | 940   | 1,576  | 171,557   | 消費者金融                |
| SYSCO CORP                        | 678     | 758   | 3,513  | 382,355   | 食品・生活必需品小売り          |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP        | 379     | 412   | 1,460  | 158,905   | 資本市場                 |
| TJX COS INC                       | 1,696   | 1,898 | 9,024  | 982,189   | 専門小売り                |
| T-MOBILE US INC                   | 472     | 530   | 4,405  | 479,435   | 無線通信サービス             |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A         | 102     | —     | —      | —         | ソフトウェア               |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 157     | 181   | 2,145  | 233,443   | 娯楽                   |
| TAPESTRY INC                      | 383     | 450   | 594    | 64,693    | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| TARGET CORP                       | 686     | 788   | 7,565  | 823,362   | 複合小売り                |
| TARGA RESOURCES CORP              | 299     | 348   | 225    | 24,541    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC         | —       | 57    | 1,704  | 185,483   | 航空宇宙・防衛              |
| TELEFLEX INC                      | 63      | 71    | 2,058  | 224,053   | ヘルスケア機器・用品           |
| TERADYNE INC                      | —       | 250   | 1,381  | 150,294   | 半導体・半導体製造装置          |
| TESLA INC                         | 175     | 212   | 10,650 | 1,159,058 | 自動車                  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR        | 1,330   | 1,670 | 1,421  | 154,665   | 医薬品                  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC             | 1,314   | 1,465 | 14,945 | 1,626,565 | 半導体・半導体製造装置          |
| TEXTRON INC                       | 335     | 335   | 926    | 100,879   | 航空宇宙・防衛              |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC      | 548     | 628   | 17,895 | 1,947,565 | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| 3M CORP                           | 797     | 902   | 12,424 | 1,352,120 | コングロマリット             |
| TIFFANY & CO                      | 144     | 169   | 2,171  | 236,322   | 専門小売り                |
| TORCHMARK CORP                    | 140     | —     | —      | —         | 保険                   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC         | 222     | —     | —      | —         | 情報技術サービス             |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY            | 163     | 178   | 1,522  | 165,725   | 専門小売り                |
| TRANSDIGM GROUP INC               | 63      | 76    | 2,625  | 285,729   | 航空宇宙・防衛              |
| TRUNSONIC                         | 253     | 290   | 1,977  | 215,180   | 専門サービス               |
| TRAVELERS COS INC/THE             | 367     | 408   | 4,185  | 455,526   | 保険                   |
| TRIMBLE INC                       | 349     | 388   | 1,203  | 131,027   | 電子装置・機器・部品           |
| TRIPADVISOR INC                   | 146     | 146   | 260    | 28,393    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| TRUIST FINANCIAL CORP             | —       | 2,085 | 6,788  | 738,820   | 銀行                   |
| TWILIO INC - A                    | —       | 186   | 1,804  | 196,351   | 情報技術サービス             |
| TWITTER INC                       | 942     | 1,147 | 2,935  | 319,434   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| TYLER TECHNOLOGIES INC            | —       | 61    | 1,834  | 199,696   | ソフトウェア               |

| 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        |                         |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 410     | 469   | 2,774  | 301,909   | 食品                      |
| UGI CORP                     | 227     | 309   | 831    | 90,494    | ガス                      |
| US BANCORP                   | 2,112   | 2,305 | 8,268  | 899,810   | 銀行                      |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | —       | 655   | 1,822  | 198,382   | 陸運・鉄道                   |
| ULTA BEAUTY INC              | 78      | 85    | 1,527  | 166,241   | 専門小売り                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 240     | 240   | 229    | 24,996    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | 250     | 250   | 210    | 22,881    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNION PAC CORP               | 1,005   | 1,088 | 15,253 | 1,660,066 | 陸運・鉄道                   |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 92      | 92    | 277    | 30,197    | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 946     | 1,099 | 10,752 | 1,170,207 | 航空貨物・物流サービス             |
| UNITED RENTALS INC           | 112     | 112   | 1,065  | 115,990   | 商社・流通業                  |
| UNITED TECHNOLOGIES          | 1,128   | 1,286 | 12,665 | 1,378,420 | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 63      | —     | —      | —         | バイオテクノロジー               |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 1,313   | 1,482 | 37,239 | 4,052,796 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 118     | 118   | 1,181  | 128,586   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNUM GROUP                   | 312     | 312   | 497    | 54,124    | 保険                      |
| V F CORP                     | 454     | 525   | 3,136  | 341,386   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VAIL RESORTS INC             | 54      | 60    | 893    | 97,267    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| VALERO ENERGY CORP           | 580     | 628   | 2,963  | 322,521   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 129     | 142   | 1,472  | 160,287   | ヘルスケア機器・用品              |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 167     | 207   | 3,269  | 355,804   | ヘルスケア・テクノロジー            |
| VERISIGN INC                 | 147     | 162   | 3,054  | 332,422   | 情報技術サービス                |
| VERIZON COMMUNICATIONS       | 5,643   | 6,468 | 35,425 | 3,855,328 | 各種電気通信サービス              |
| VERISK ANALYTICS INC         | 219     | 242   | 3,554  | 386,809   | 専門サービス                  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS       | 350     | 404   | 9,369  | 1,019,690 | バイオテクノロジー               |
| VIACOM INC-CLASS B           | 502     | —     | —      | —         | 娯楽                      |
| VIACOMCBS INC-CLASS B        | —       | 880   | 1,239  | 134,892   | メディア                    |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 2,404   | 2,678 | 44,339 | 4,825,483 | 情報技術サービス                |
| VISTRA ENERGY CORP           | 482     | 590   | 947    | 103,120   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| VMWARE INC - CLASS A         | 116     | 130   | 1,566  | 170,510   | ソフトウェア                  |
| VOYA FINANCIAL INC           | 217     | 217   | 899    | 97,936    | 各種金融サービス                |
| VULCAN MATERIALS CO          | 186     | 208   | 2,118  | 230,576   | 建設資材                    |
| WABCO HOLDINGS INC           | 70      | 81    | 1,094  | 119,111   | 機械                      |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 435     | 498   | 4,576  | 498,019   | 総合公益事業                  |
| WABTEC CORP                  | 179     | 288   | 1,417  | 154,270   | 機械                      |
| WALMART INC                  | 1,989   | 2,225 | 25,629 | 2,789,288 | 食品・生活必需品小売り             |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,101   | 1,182 | 5,337  | 580,924   | 食品・生活必需品小売り             |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 368     | 403   | 3,118  | 339,420   | 商業サービス・用品               |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 578     | 668   | 6,319  | 687,727   | 商業サービス・用品               |
| WATERS CORP                  | 106     | 103   | 1,937  | 210,895   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| WAYFAIR INC - CLASS A        | 75      | 86    | 447    | 48,678    | インターネット販売・通信販売          |
| WELL CARE HEALTH PLANS INC   | 70      | —     | —      | —         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WELLS FARGO CO               | 6,129   | 6,291 | 18,822 | 2,048,471 | 銀行                      |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | —       | 118   | 1,791  | 194,953   | ヘルスケア機器・用品              |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 383     | 476   | 2,071  | 225,395   | コンピュータ・周辺機器             |
| WESTERN UNION CO             | 590     | 660   | 1,248  | 135,826   | 情報技術サービス                |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 50      | 50    | 189    | 20,606    | 化学                      |
| WESTROCK CO                  | 342     | 387   | 1,122  | 122,139   | 容器・包装                   |
| WHIRLPOOL CORP               | 93      | 94    | 824    | 89,727    | 家庭用耐久財                  |
| WILLIAMS COS                 | 1,681   | 1,910 | 2,639  | 287,269   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 207     | 254   | 3,487  | 379,535   | ソフトウェア                  |
| WORLDPAY INC - CL A          | 407     | —     | —      | —         | 情報技術サービス                |
| WYNN RESORTS LTD             | 138     | 155   | 947    | 103,067   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| XPO LOGISTICS INC            | 180     | 143   | 735    | 80,038    | 航空貨物・物流サービス             |

| 銘柄                                     | 期首(前期末) |       | 当期     |           | 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        |    |  |                      |
| XCEL ENERGY INC                        | 708     | 812   | 5,079  | 552,842   |    |  | 電力                   |
| XILINX INC                             | 349     | 399   | 3,166  | 344,562   |    |  | 半導体・半導体製造装置          |
| XEROX CORP                             | 289     | —     | —      | —         |    |  | コンピュータ・周辺機器          |
| XYLEM INC                              | 239     | 278   | 1,841  | 200,407   |    |  | 機械                   |
| XEROX HOLDINGS CORP                    | —       | 289   | 518    | 56,456    |    |  | コンピュータ・周辺機器          |
| YUM BRANDS INC                         | 422     | 471   | 3,328  | 362,246   |    |  | ホテル・レストラン・レジャー       |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC                | 264     | —     | —      | —         |    |  | 各種電気通信サービス           |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A           | —       | 84    | 1,582  | 172,184   |    |  | 電子装置・機器・部品           |
| ZILLOW GROUP INC - C                   | 160     | 202   | 748    | 81,471    |    |  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC             | 284     | 319   | 3,135  | 341,196   |    |  | ヘルスケア機器・用品           |
| ZIONS BANCORP NA                       | 275     | 275   | 756    | 82,362    |    |  | 銀行                   |
| ZOETIS INC                             | 660     | 740   | 8,634  | 939,673   |    |  | 医薬品                  |
| ALKERMES PLC                           | 201     | —     | —      | —         |    |  | バイオテクノロジー            |
| ALLEGION PLC                           | 136     | 148   | 1,406  | 153,031   |    |  | 建設関連製品               |
| ALLERGAN PLC                           | 464     | 510   | 8,991  | 978,578   |    |  | 医薬品                  |
| AMCOR PLC                              | —       | 2,500 | 2,070  | 225,278   |    |  | 容器・包装                |
| AON PLC                                | 329     | 369   | 6,311  | 686,826   |    |  | 保険                   |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                 | 560     | 639   | 1,951  | 212,382   |    |  | 保険                   |
| ATHENA HOLDING LTD-CLASS A             | 214     | 212   | 557    | 60,702    |    |  | 保険                   |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD             | 292     | 292   | 527    | 57,423    |    |  | 化学                   |
| ACCENTURE PLC-CL A                     | 870     | 995   | 16,897 | 1,838,910 |    |  | 情報技術サービス             |
| BUNGE LIMITED                          | 191     | 220   | 870    | 94,788    |    |  | 食品                   |
| CAPRI HOLDINGS LTD                     | 199     | 199   | 223    | 24,364    |    |  | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS            | 292     | 351   | 1,291  | 140,573   |    |  | 飲料                   |
| EATON CORP PLC                         | 601     | 645   | 5,051  | 549,769   |    |  | 電気設備                 |
| EVEREST RE GROUP LTD                   | 56      | 62    | 1,230  | 133,930   |    |  | 保険                   |
| IHS MARKIT LTD                         | 547     | 593   | 3,668  | 399,220   |    |  | 専門サービス               |
| INGERSOLL-RAND PLC                     | 334     | —     | —      | —         |    |  | 機械                   |
| INVESCO LTD                            | 580     | 580   | 554    | 60,344    |    |  | 資本市場                 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC               | 78      | 90    | 896    | 97,555    |    |  | 医薬品                  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC     | 1,271   | 1,200 | 3,178  | 345,948   |    |  | 建設関連製品               |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A                   | 240     | 240   | 400    | 43,592    |    |  | メディア                 |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C           | 695     | 640   | 1,004  | 109,352   |    |  | メディア                 |
| LINDE PLC                              | 751     | 842   | 14,886 | 1,620,104 |    |  | 化学                   |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD           | 860     | 990   | 2,247  | 244,573   |    |  | 半導体・半導体製造装置          |
| MEDTRONIC PLC                          | 1,838   | 2,099 | 19,321 | 2,102,736 |    |  | ヘルスケア機器・用品           |
| APTIV PLC                              | 367     | 392   | 1,956  | 212,965   |    |  | 自動車部品                |
| NIELSEN HOLDINGS PLC                   | 472     | 540   | 706    | 76,927    |    |  | 専門サービス               |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN           | 302     | 330   | 352    | 38,356    |    |  | ホテル・レストラン・レジャー       |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD             | 59      | 67    | 1,019  | 110,912   |    |  | 保険                   |
| SEAGATE TECHNOLOGY                     | 378     | 373   | 1,860  | 202,440   |    |  | コンピュータ・周辺機器          |
| PENTAIR PLC                            | 232     | 232   | 687    | 74,811    |    |  | 機械                   |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING           | 214     | 245   | 719    | 78,283    |    |  | 電気設備                 |
| STERIS PLC                             | —       | 129   | 1,805  | 196,532   |    |  | ヘルスケア機器・用品           |
| TECHNIPFMC PLC                         | 610     | 610   | 430    | 46,802    |    |  | エネルギー設備・サービス         |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC                 | —       | 376   | 3,169  | 344,956   |    |  | 機械                   |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC               | 178     | 202   | 3,493  | 380,207   |    |  | 保険                   |
| PERRIGO CO PLC                         | 165     | 196   | 956    | 104,115   |    |  | 医薬品                  |
| CHUBB LTD                              | 633     | 712   | 8,119  | 883,661   |    |  | 保険                   |
| GARMIN LTD                             | 152     | 205   | 1,572  | 171,096   |    |  | 家庭用耐久財               |
| TE CONNECTIVITY LTD                    | 479     | 524   | 3,338  | 363,375   |    |  | 電子装置・機器・部品           |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 172     | 189   | 1,874  | 204,022   |    |  | ソフトウェア               |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL           | —       | 55    | 477    | 51,931    |    |  | ソフトウェア               |
| WIX.COM LTD                            | 57      | 77    | 804    | 87,553    |    |  | 情報技術サービス             |

| 銘柄                                 | 株数      | 当期末     |           |             | 業種等            |
|------------------------------------|---------|---------|-----------|-------------|----------------|
|                                    |         | 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          |                |
| AERCAP HOLDINGS NV                 | 169     | 170     | 387       | 42,145      | 商社・流通業         |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A           | 455     | 421     | 2,087     | 227,162     | 化学             |
| MYLAN NV                           | 693     | 770     | 1,160     | 126,285     | 医薬品            |
| NXP SEMICONDUCTORS NV              | 468     | 432     | 3,668     | 399,294     | 半導体・半導体製造装置    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD        | 227     | 266     | 791       | 86,180      | ホテル・レストラン・レジャー |
| FLEX LTD                           | 760     | 760     | 638       | 69,477      | 電子装置・機器・部品     |
| 小計                                 | 413,057 | 465,696 | 3,471,191 | 377,769,781 |                |
| 株数・金額<br>銘柄数<比率>                   | 596     | 608     | —         | <67.9%>     |                |
| (カナダ)                              |         |         | 千カナダドル    |             |                |
| ARC RESOURCES LTD                  | 500     | —       | —         | —           | 石油・ガス・消耗燃料     |
| AGNICO EAGLE MINES LTD             | 331     | 377     | 2,134     | 163,537     | 金属・鉱業          |
| AIR CANADA                         | —       | 204     | 328       | 25,127      | 旅客航空輸送業        |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES        | —       | 850     | 1,518     | 116,351     | 総合公益事業         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B         | 596     | 1,342   | 4,412     | 337,997     | 食品・生活必需品小売り    |
| ALTAGAS LTD                        | 338     | 420     | 494       | 37,866      | ガス             |
| ATCO LTD CL1                       | 96      | 130     | 487       | 37,352      | 総合公益事業         |
| AURORA CANNABIS INC                | 970     | 2,000   | 258       | 19,762      | 医薬品            |
| BCE INC                            | 198     | 227     | 1,251     | 95,895      | 各種電気通信サービス     |
| BANK OF MONTREAL                   | 876     | 990     | 6,713     | 514,230     | 銀行             |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX        | 1,682   | 1,893   | 10,375    | 794,765     | 銀行             |
| BARRICK GOLD                       | 2,366   | 2,770   | 7,559     | 579,044     | 金属・鉱業          |
| BAUSCH HEALTH COS INC              | 425     | 510     | 1,101     | 84,382      | 医薬品            |
| BLACKBERRY LTD                     | 710     | 710     | 393       | 30,129      | ソフトウェア         |
| BOMBARDIER B SHEARS                | 2,620   | 2,800   | 119       | 9,115       | 航空宇宙・防衛        |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A       | 1,168   | 1,402   | 8,759     | 670,992     | 資本市場           |
| CAE INC                            | 360     | 410     | 741       | 56,782      | 航空宇宙・防衛        |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B          | 212     | 247     | 976       | 74,810      | 容器・包装          |
| CGI INC                            | 338     | 384     | 2,848     | 218,225     | 情報技術サービス       |
| CI FINANCIAL CORP                  | 336     | 336     | 442       | 33,922      | 資本市場           |
| CAMECO CORP                        | 560     | 560     | 584       | 44,783      | 石油・ガス・消耗燃料     |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 600     | 696     | 5,498     | 421,177     | 銀行             |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO           | 1,001   | 1,124   | 12,176    | 932,703     | 陸運・鉄道          |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD     | 1,631   | 1,870   | 2,939     | 225,176     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD       | 198     | 213     | 6,558     | 502,379     | 陸運・鉄道          |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A           | 86      | 86      | 738       | 56,567      | 複合小売り          |
| CANADIAN UTILITIES LTD A           | 157     | 203     | 675       | 51,765      | 総合公益事業         |
| CANOPY GROWTH CORP                 | 275     | 330     | 677       | 51,895      | 医薬品            |
| CENOVUS ENERGY INC                 | 1,400   | 1,560   | 375       | 28,798      | 石油・ガス・消耗燃料     |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC         | 27      | 32      | 4,082     | 312,748     | ソフトウェア         |
| CRONOS GROUP INC                   | 250     | 250     | 225       | 17,273      | 医薬品            |
| DOLLARAMA INC                      | 418     | 466     | 1,900     | 145,566     | 複合小売り          |
| EMERA INC                          | 76      | 379     | 2,046     | 156,769     | 電力             |
| EMPIRE CO LTD A                    | 260     | 260     | 711       | 54,470      | 食品・生活必需品小売り    |
| ENCANA CORP                        | 2,060   | —       | —         | —           | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ENBRIDGE INC                       | 2,759   | 3,178   | 12,696    | 972,522     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD        | 38      | 41      | 1,695     | 129,884     | 保険             |
| FINNING INTERNATIONAL INC          | 240     | —       | —         | —           | 商社・流通業         |
| FIRST CAPITAL REALTY INC           | 250     | —       | —         | —           | 不動産管理・開発       |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD         | 990     | 990     | 692       | 53,007      | 金属・鉱業          |
| FORTIS INC                         | 583     | 682     | 3,579     | 274,214     | 電力             |
| FRANCO-NEVADA CORP                 | 254     | 293     | 4,057     | 310,801     | 金属・鉱業          |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC              | 278     | 318     | 572       | 43,870      | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| GOLDCORP INC                       | 1,210   | —       | —         | —           | 金属・鉱業          |
| GREAT-WEST LIFECO INC              | 420     | —       | —         | —           | 保険             |

| 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        |                |
| GREAT-WEST LIFE CO INC              | —       | 420   | 987    | 75,604    | 保険             |
| HUSKY ENERGY INC                    | 520     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料     |
| HUSKY ENERGY INC                    | —       | 520   | 166    | 12,786    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| HYDRO ONE LTD                       | 420     | 490   | 1,236  | 94,735    | 電力             |
| IGM FINANCIAL INC                   | 103     | 150   | 350    | 26,875    | 資本市場           |
| IA FINANCIAL CORP INC               | 147     | 183   | 780    | 59,757    | 保険             |
| IMPERIAL OIL                        | 375     | 375   | 557    | 42,685    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| INTACT FINANCIAL CORP               | 189     | 215   | 2,483  | 190,249   | 保険             |
| INTER PIPELINE LTD                  | 520     | 600   | 470    | 36,032    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| KEYERA CORP                         | 285     | 340   | 398    | 30,523    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| KINROSS GOLD CORP                   | 1,740   | 1,980 | 1,140  | 87,360    | 金属・鉱業          |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD              | —       | 441   | 1,908  | 146,202   | 金属・鉱業          |
| LOBLAW COMPANIES                    | 261     | 285   | 1,970  | 150,939   | 食品・生活必需品小売り    |
| LUNDIN MINING CORP                  | 950     | 950   | 477    | 36,603    | 金属・鉱業          |
| MAGNA INTERNATIONAL INC             | 445     | 451   | 2,028  | 155,390   | 自動車部品          |
| MANULIFE FINANCIAL CORP             | 2,750   | 3,030 | 5,151  | 394,566   | 保険             |
| METHANEX CORP                       | 86      | 86    | 147    | 11,310    | 化学             |
| METRO INC                           | 334     | 396   | 2,250  | 172,385   | 食品・生活必需品小売り    |
| NATIONAL BANK OF CANADA             | 460     | 523   | 2,721  | 208,441   | 銀行             |
| NUTRIEN LTD                         | 831     | 900   | 4,134  | 316,710   | 化学             |
| ONEX CORPORATION                    | 109     | 132   | 673    | 51,567    | 各種金融サービス       |
| OPEN TEXT CORP                      | 354     | 417   | 2,023  | 155,015   | ソフトウェア         |
| OVINTIV INC                         | —       | 410   | 141    | 10,803    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| PARKLAND FUEL CORP                  | —       | 217   | 543    | 41,638    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| PEMBINA PIPELINE CORP               | 706     | 880   | 2,081  | 159,419   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| POWER CORPORATION OF CANADA         | 460     | 869   | 1,868  | 143,131   | 保険             |
| POWER FINANCIAL CORP                | 325     | —     | —      | —         | 保険             |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD              | 310     | 310   | 218    | 16,764    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| QUEBECOR INC-CL B                   | —       | 270   | 844    | 64,713    | メディア           |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 320     | 433   | 2,468  | 189,122   | ホテル・レストラン・レジャー |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B          | 502     | 555   | 3,174  | 243,174   | 無線通信サービス       |
| ROYAL BANK OF CANADA                | 1,962   | 2,248 | 19,063 | 1,460,228 | 銀行             |
| SNC-LAVALIN GROUP INC               | 252     | —     | —      | —         | 建設・土木          |
| SAPUTO INC                          | 321     | 366   | 1,218  | 93,330    | 食品             |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A        | 370     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料     |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B           | 630     | 770   | 1,711  | 131,116   | メディア           |
| SHOPIFY INC - CLASS A               | 122     | 163   | 9,967  | 763,531   | 情報技術サービス       |
| STARS GROUP INC/THE                 | 230     | 380   | 978    | 74,953    | ホテル・レストラン・レジャー |
| SUN LIFE FINANCIAL INC              | 838     | 923   | 4,079  | 312,501   | 保険             |
| SUNCOR ENERGY INC                   | 2,180   | 2,440 | 4,628  | 354,556   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TC ENERGY CORP                      | —       | 1,470 | 8,565  | 656,131   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B            | 680     | 820   | 801    | 61,430    | 金属・鉱業          |
| TELUS CORP                          | 293     | 586   | 1,257  | 96,328    | 各種電気通信サービス     |
| THOMSON REUTERS CORP                | 282     | 317   | 2,987  | 228,859   | 専門サービス         |
| TORONTO DOMINION BANK               | 2,495   | 2,841 | 16,608 | 1,272,210 | 銀行             |
| TOURMALINE OIL CORP                 | 330     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TRANSCANADA CORP                    | 1,257   | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD        | 1,260   | —     | —      | —         | 金属・鉱業          |
| VERMILION ENERGY INC                | 185     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料     |
| WSP GLOBAL INC                      | 132     | 157   | 1,186  | 90,906    | 建設・土木          |
| WEST FRASER TIMBER                  | 84      | 84    | 224    | 17,186    | 紙製品・林産品        |
| WESTON (GEORGE) LTD                 | 107     | 123   | 1,216  | 93,191    | 食品・生活必需品小売り    |

| 銘柄                           | 株数      | 期首(前期末) |        | 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        |            |                |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 630     | 716     | 2,826  | 216,475   |            | 金属・鉱業          |
| 小計                           | 株数・金額   | 58,286  | 62,765 | 234,126   | 17,934,123 |                |
|                              | 銘柄数<比率> | 89      | 84     | —         | <3.2%>     |                |
| (イギリス)                       |         |         |        | 千英ポンド     |            |                |
| ANTOFAGASTA PLC              | 590     | 590     | 431    | 57,562    |            | 金属・鉱業          |
| ASHTAD GROUP PLC             | 680     | 687     | 1,121  | 149,567   |            | 商社・流通業         |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 1,450   | 1,590   | 708    | 94,436    |            | 家庭用耐久財         |
| AVIVA PLC                    | 5,420   | 6,040   | 1,617  | 215,646   |            | 保険             |
| DIAGEO PLC                   | 3,319   | 3,681   | 9,476  | 1,263,438 |            | 飲料             |
| SCHRODERS PLC                | 158     | 197     | 496    | 66,185    |            | 資本市場           |
| DCC PLC                      | 128     | 160     | 828    | 110,495   |            | コングロマリット       |
| BAE SYSTEMS PLC              | 4,410   | 5,020   | 2,552  | 340,255   |            | 航空宇宙・防衛        |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 3,125   | 3,597   | 9,478  | 1,263,619 |            | タバコ            |
| HALMA PLC                    | —       | 590     | 1,103  | 147,091   |            | 電子装置・機器・部品     |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 3,830   | 4,140   | 1,885  | 251,410   |            | 銀行             |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 1,295   | 1,490   | 1,986  | 264,796   |            | タバコ            |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 27,340  | 31,810  | 14,716 | 1,962,056 |            | 銀行             |
| LEGAL & GENERAL              | 8,080   | 9,400   | 1,807  | 240,929   |            | 保険             |
| MEGGITT PLC                  | 1,110   | 1,110   | 298    | 39,808    |            | 航空宇宙・防衛        |
| MORRISON SUPERMARKETS        | 3,150   | 3,700   | 674    | 89,975    |            | 食品・生活必需品小売り    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 494     | 541     | 942    | 125,715   |            | 食品             |
| PEARSON                      | 1,090   | 1,260   | 706    | 94,204    |            | メディア           |
| PERSIMMON PLC                | 426     | 480     | 875    | 116,756   |            | 家庭用耐久財         |
| PRUDENTIAL PLC               | 3,550   | 4,100   | 4,110  | 547,978   |            | 保険             |
| RIO TINTO PLC-REG            | 1,578   | 1,749   | 6,425  | 856,691   |            | 金属・鉱業          |
| ST JAMES S PLACE PLC         | 700     | 810     | 610    | 81,445    |            | 資本市場           |
| SSE PLC                      | 1,370   | 1,650   | 2,085  | 278,052   |            | 電力             |
| BP PLC                       | 27,490  | 31,780  | 10,284 | 1,371,063 |            | 石油・ガス・消耗燃料     |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 97,300  | 110,500 | 3,701  | 493,517   |            | 銀行             |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 4,500   | 5,000   | 586    | 78,192    |            | 家庭用耐久財         |
| TESCO PLC                    | 13,620  | 15,300  | 3,566  | 475,476   |            | 食品・生活必需品小売り    |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 1,230   | 1,370   | 1,972  | 262,922   |            | ヘルスケア機器・用品     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 6,760   | 7,820   | 11,589 | 1,545,077 |            | 医薬品            |
| WEIR GROUP PLC               | 370     | 380     | 253    | 33,750    |            | 機械             |
| BABCOCK INTL GROUP PLC       | 390     | —       | —      | —         |            | 商業サービス・用品      |
| ASTRAZENECA PLC              | 1,727   | 2,055   | 14,596 | 1,946,027 |            | 医薬品            |
| BT GROUP PLC                 | 11,450  | 12,900  | 1,540  | 205,381   |            | 各種電気通信サービス     |
| CARNIVAL PLC                 | 229     | 229     | 208    | 27,758    |            | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER PLC          | 2,080   | 3,100   | 306    | 40,899    |            | 複合小売り          |
| BARCLAYS PLC                 | 23,700  | 27,400  | 2,575  | 343,378   |            | 銀行             |
| INTERTEK GROUP PLC           | 216     | 256     | 1,186  | 158,123   |            | 専門サービス         |
| BURBERRY GROUP PLC           | 550     | 660     | 864    | 115,268   |            | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEXT PLC                     | 198     | 198     | 784    | 104,639   |            | 複合小売り          |
| KINGFISHER PLC               | 3,080   | 3,080   | 439    | 58,534    |            | 専門小売り          |
| ITV PLC                      | 5,000   | 5,000   | 311    | 41,582    |            | メディア           |
| SAINSBURY                    | 2,550   | 2,550   | 536    | 71,460    |            | 食品・生活必需品小売り    |
| G4S PLC                      | 2,190   | 2,190   | 191    | 25,529    |            | 商業サービス・用品      |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 270     | 308     | 677    | 90,378    |            | 保険             |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS    | 171     | 195     | 702    | 93,590    |            | 家庭用耐久財         |
| CENTRICA PLC                 | 7,800   | 9,200   | 353    | 47,074    |            | 総合公益事業         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 6,170   | 6,560   | 8,693  | 1,158,992 |            | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B      | 5,107   | 5,860   | 7,395  | 985,944   |            | 石油・ガス・消耗燃料     |
| BUNZLE                       | 444     | 500     | 777    | 103,622   |            | 商社・流通業         |
| RENTOKIL INTIAL PLC          | —       | 2,850   | 1,100  | 146,665   |            | 商業サービス・用品      |

| 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      |                         |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC   | 426     | 492    | 3,602 | 480,275 | 資本市場                    |
| UNILEVER PLC                      | 1,509   | 1,742  | 6,995 | 932,689 | パーソナル用品                 |
| TUI AG-DI                         | 600     | 700    | 256   | 34,137  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INVESTEC PLC                      | 920     | —      | —     | —       | 資本市場                    |
| EXPERIAN PLC                      | 1,262   | 1,411  | 3,313 | 441,692 | 専門サービス                  |
| MONDI PLC                         | 494     | 750    | 1,003 | 133,836 | 紙製品・林産品                 |
| SEVERN TRENT PLC                  | 324     | 370    | 862   | 114,984 | 水道                      |
| WHITBREAD PLC                     | 245     | 211    | 626   | 83,491  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC           | 401     | 520    | 708   | 94,491  | 資本市場                    |
| SMITHS GROUP PLC                  | 540     | 610    | 680   | 90,718  | コングロマリット                |
| ANGLO AMERICAN PLC                | 1,433   | 1,600  | 2,140 | 285,368 | 金属・鉱業                   |
| 3I GROUP PLC                      | 1,320   | 1,550  | 1,183 | 157,836 | 資本市場                    |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 913     | 1,102  | 6,832 | 910,895 | 家庭用品                    |
| RELX PLC                          | 2,710   | 3,000  | 5,181 | 690,730 | 専門サービス                  |
| FRESNILLO PLC                     | 260     | —      | —     | —       | 金属・鉱業                   |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC        | 960     | 1,060  | 1,004 | 133,885 | 水道                      |
| OCADO GROUP PLC                   | —       | 720    | 889   | 118,644 | インターネット販売・通信販売          |
| GLENCORE PLC                      | 15,330  | 17,000 | 2,023 | 269,706 | 金属・鉱業                   |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC             | 860     | —      | —     | —       | エネルギー設備・サービス            |
| GVC HOLDINGS PLC                  | 710     | 870    | 435   | 57,994  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          | 2,370   | 2,770  | 890   | 118,654 | 航空宇宙・防衛                 |
| EVRAZ PLC                         | —       | 760    | 172   | 22,969  | 金属・鉱業                   |
| NMC HEALTH PLC                    | 133     | 133    | 31    | 4,159   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EASYJET PLC                       | 210     | 210    | 115   | 15,454  | 旅客航空輸送業                 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP      | 6,500   | 7,700  | 903   | 120,518 | 銀行                      |
| SAGE GROUP PLC (THE)              | 1,430   | 1,750  | 1,050 | 139,986 | ソフトウェア                  |
| WPP PLC                           | 1,690   | 2,000  | 1,031 | 137,532 | メディア                    |
| COCA-COLA HBC AG-DI               | 290     | 290    | 477   | 63,638  | 飲料                      |
| AVEVA GROUP PLC                   | —       | 112    | 387   | 51,664  | ソフトウェア                  |
| CONVATEC GROUP PLC-WI             | 2,100   | —      | —     | —       | ヘルスケア機器・用品              |
| COMPASS GROUP PLC                 | 2,150   | 2,510  | 2,988 | 398,380 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC     | 580     | —      | —     | —       | ソフトウェア                  |
| NATIONAL GRID PLC                 | 4,610   | 5,480  | 5,228 | 697,059 | 総合公益事業                  |
| ROYAL MAIL PLC                    | 1,360   | —      | —     | —       | 航空貨物・物流サービス             |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI      | 890     | —      | —     | —       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC        | 3,590   | 3,660  | 815   | 108,715 | 資本市場                    |
| FERGUSON PLC                      | 325     | —      | —     | —       | 商社・流通業                  |
| BHP GROUP PLC                     | 2,890   | 3,290  | 4,007 | 534,330 | 金属・鉱業                   |
| VODAFONE GROUP PLC                | 36,500  | 42,100 | 4,813 | 641,764 | 無線通信サービス                |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 237     | 258    | 875   | 116,741 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC     | —       | 481    | 192   | 25,659  | ソフトウェア                  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           | —       | 193    | 812   | 108,275 | 化学                      |
| FERGUSON PLC                      | —       | 346    | 1,705 | 227,414 | 商社・流通業                  |
| M&G PLC                           | —       | 3,780  | 444   | 59,214  | 各種金融サービス                |
| RSA INSURANCE GROUP PLC           | 1,400   | 1,620  | 677   | 90,365  | 保険                      |
| INFORMA PLC                       | 1,730   | 1,860  | 786   | 104,893 | メディア                    |
| AUTO TRADER GROUP PLC             | 1,380   | 1,410  | 625   | 83,332  | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      | —       | 116    | 948   | 126,504 | 機械                      |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       | 1,830   | 2,190  | 606   | 80,875  | 保険                      |
| JD SPORTS FASHION PLC             | —       | 760    | 348   | 46,497  | 専門小売り                   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           | 172     | —      | —     | —       | 化学                      |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | 6,800   | 7,300  | 638   | 85,158  | 電気設備                    |

| 銘柄                               | 株数               | 当 期 末   |         | 業 種 等     |                   |  |
|----------------------------------|------------------|---------|---------|-----------|-------------------|--|
|                                  |                  | 株数      | 評 価 額   |           |                   |  |
| (イギリス)                           | 百株               | 百株      | 千英ポンド   | 千円        |                   |  |
| JOHNSON MATTHEY PLC              | 267              | 302     | 539     | 71,949    | 化学                |  |
| 小 計                              | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 410,536 | 468,722 | 209,991   | 27,996,065        |  |
| (スイス)                            | 92               | 93      | —       | <5.0%>    |                   |  |
| SGS SA-REG                       | 7                | 9       | 2,070   | 234,344   | 専門サービス            |  |
| BARRY CALLEBAUT AG               | 3                | 4       | 896     | 101,497   | 食品                |  |
| SWISSCOM AG-REG                  | 35               | 40      | 2,160   | 244,542   | 各種電気通信サービス        |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC       | 1                | 1       | 1,221   | 138,250   | 食品                |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG      | 0.15             | 0.17    | 1,390   | 157,429   | 食品                |  |
| GIVAUDAN-REG                     | 12               | 14      | 4,337   | 491,054   | 化学                |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG        | 207              | 235     | 7,814   | 884,704   | 保険                |  |
| NOVARTIS AG-REG                  | 2,960            | 3,361   | 26,148  | 2,960,280 | 医薬品               |  |
| ABB LTD                          | 2,500            | 2,850   | 4,742   | 536,887   | 電気設備              |  |
| ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)     | 959              | 1,098   | 33,927  | 3,840,972 | 医薬品               |  |
| ADECCO GROUP AG-REG              | 215              | 249     | 915     | 103,680   | 専門サービス            |  |
| LAFARGEHOLCIM LTD                | 670              | 774     | 2,650   | 300,114   | 建設資材              |  |
| CLARIANT AG-REG                  | 259              | 320     | 508     | 57,546    | 化学                |  |
| NESTLE SA-REG                    | 4,184            | 4,652   | 46,426  | 5,255,996 | 食品                |  |
| BALOISE HOLDING AG               | 66               | 74      | 922     | 104,467   | 保険                |  |
| TEMENOS AG-REG                   | 84               | 104     | 1,284   | 145,406   | ソフトウェア            |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG            | 76               | 88      | 1,518   | 171,852   | ヘルスケア機器・用品        |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG         | 14               | 16      | 1,130   | 128,026   | ヘルスケア機器・用品        |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG       | 3,470            | 3,960   | 3,167   | 358,559   | 資本市場              |  |
| THE SWATCH GROUP AG-B            | 41               | 47      | 886     | 100,378   | 繊維・アパレル・贅沢品       |  |
| THE SWATCH GROUP AG-REG          | 74               | 74      | 274     | 31,047    | 繊維・アパレル・贅沢品       |  |
| LONZA AG-REG                     | 103              | 115     | 4,544   | 514,477   | ライフサイエンス・ツール/サービス |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG            | 45               | 51      | 1,678   | 190,016   | 保険                |  |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG        | 12               | 12      | 725     | 82,110    | 化学                |  |
| SWISS PRIME SITE-REG             | 101              | 114     | 1,070   | 121,186   | 不動産管理・開発          |  |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES | 58               | 58      | 370     | 41,957    | 各種金融サービス          |  |
| DUFREY AG-REG                    | 44               | 65      | 194     | 22,024    | 専門小売り             |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG        | 24               | 29      | 1,990   | 225,371   | 資本市場              |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT      | 55               | 61      | 1,266   | 143,433   | 機械                |  |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG         | 30               | 30      | 589     | 66,771    | 機械                |  |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG       | 73               | 84      | 1,108   | 125,479   | 海運業               |  |
| GEBERIT AG-REG                   | 50               | 56      | 2,396   | 271,269   | 建設関連製品            |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD            | 310              | 358     | 1,181   | 133,786   | 資本市場              |  |
| SWISS RE LTD                     | 414              | 462     | 3,247   | 367,690   | 保険                |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A    | 716              | 815     | 4,246   | 480,706   | 繊維・アパレル・贅沢品       |  |
| SIKA AG-REG                      | 180              | 199     | 3,143   | 355,842   | 化学                |  |
| ALCON INC                        | —                | 659     | 3,211   | 363,589   | ヘルスケア機器・用品        |  |
| UBS GROUP AG                     | 5,330            | 6,010   | 5,447   | 616,707   | 資本市場              |  |
| VIFOR PHARMA AG                  | 57               | 67      | 853     | 96,595    | 医薬品               |  |
| 小 計                              | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 23,443  | 27,221  | 181,662   | 20,566,059        |  |
| (スウェーデン)                         | 92               | 126     | —       | <3.7%>    |                   |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS               | 92               | 126     | 5,057   | 54,673    | 各種金融サービス          |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 2,210            | 2,510   | 16,586  | 179,295   | 銀行                |  |
| SWEDBANK AB                      | 1,260            | 1,370   | 14,782  | 159,796   | 銀行                |  |
| SWEDISH MATCH AB                 | 234              | 260     | 13,951  | 150,816   | タバコ               |  |
| SECURITAS AB-B SHS               | 450              | 450     | 4,736   | 51,198    | 商業サービス・用品         |  |
| INVESTOR AB-B SHS                | 617              | 715     | 32,053  | 346,497   | 各種金融サービス          |  |
| HENNES&MAURITZ AB-B              | 1,180            | 1,270   | 15,527  | 167,847   | 専門小売り             |  |
| ERICSSON LM-B                    | 4,170            | 4,740   | 37,294  | 403,151   | 通信機器              |  |

| 銘柄                                  | 株数           | 株数     | 期 末         |         | 業 種 等       |  |
|-------------------------------------|--------------|--------|-------------|---------|-------------|--|
|                                     |              |        | 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      |             |  |
| TELIA CO AB                         | 3,960        | 4,300  | 15,265      | 165,014 | 各種電気通信サービス  |  |
| SKANSKA AB-B SHS                    | 450          | 510    | 7,494       | 81,015  | 建設・土木       |  |
| LUNDIN PETROLEUM AB                 | 248          | 288    | 4,968       | 53,704  | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| ALFA LAVAL AB                       | 389          | 510    | 8,774       | 94,852  | 機械          |  |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR | 97           | 158    | 4,392       | 47,481  | 無線通信サービス    |  |
| ICA GRUPPEN AB                      | 105          | 138    | 5,662       | 61,207  | 食品・生活必需品小売り |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS                  | 550          | 550    | 2,698       | 29,174  | 家庭用耐久財      |  |
| ELECTROLUX AB-B                     | 340          | 340    | 4,125       | 44,600  | 家庭用耐久財      |  |
| SKF AB-B SHARES                     | 550          | 580    | 7,682       | 83,043  | 機械          |  |
| VOLVO AB-B SHS                      | 2,140        | 2,340  | 26,617      | 287,735 | 機械          |  |
| SANDVIK AB                          | 1,510        | 1,780  | 25,026      | 270,539 | 機械          |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS             | 250          | 250    | 4,817       | 52,077  | 各種金融サービス    |  |
| HEXAGON AB-B SHS                    | 361          | 423    | 17,359      | 187,660 | 電子装置・機器・部品  |  |
| TELE 2 AB-B SHS                     | 690          | 780    | 10,327      | 111,637 | 無線通信サービス    |  |
| KINNEVIK AB - B                     | 337          | -      | -           | -       | 各種金融サービス    |  |
| ATLAS COPCO AB-A                    | 940          | 1,045  | 34,589      | 373,912 | 機械          |  |
| ATLAS COPCO AB-B                    | 529          | 627    | 18,139      | 196,083 | 機械          |  |
| BOLIDEN AB                          | 363          | -      | -           | -       | 金属・鉱業       |  |
| EPIROC AB - A                       | 920          | 1,030  | 10,164      | 109,873 | 機械          |  |
| EPIROC AB - B                       | 580          | 580    | 5,738       | 62,033  | 機械          |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B                 | 817          | 925    | 28,203      | 304,877 | 家庭用品        |  |
| BOLIDEN AB                          | -            | 440    | 7,508       | 81,167  | 金属・鉱業       |  |
| KINNEVIK AB - B                     | -            | 390    | 6,312       | 68,234  | 各種金融サービス    |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A             | 2,120        | 2,430  | 19,371      | 209,410 | 銀行          |  |
| ASSA ABLOY AB-B                     | 1,360        | 1,590  | 28,866      | 312,046 | 建設関連製品      |  |
| NORDEA BANK ABP                     | 4,130        | 5,150  | 28,041      | 303,131 | 銀行          |  |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額    | 33,949 | 38,595      | 472,136 | 5,103,793   |  |
|                                     | 銘柄 数 < 比 率 > | 32     | 32          | -       | < 0.9% >    |  |
| (ノルウェー)                             |              |        | 千ノルウェークローネ  |         |             |  |
| DNB ASA                             | 1,350        | 1,450  | 16,363      | 167,886 | 銀行          |  |
| TELENOR ASA                         | 1,020        | 1,160  | 17,649      | 181,082 | 各種電気通信サービス  |  |
| EQUINOR ASA                         | 1,610        | 1,580  | 18,999      | 194,934 | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA              | 232          | 262    | 8,499       | 87,202  | 化学          |  |
| MOWI ASA                            | 620          | 690    | 10,746      | 110,261 | 食品          |  |
| NORSK HYDRO                         | 1,840        | 2,180  | 4,843       | 49,699  | 金属・鉱業       |  |
| AKER AB ASA                         | 141          | 180    | 2,151       | 22,069  | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| ORKLA ASA                           | 1,150        | 1,150  | 10,589      | 108,645 | 食品          |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA           | 250          | 310    | 5,380       | 55,199  | 保険          |  |
| SCHIBSTED ASA-B SHS                 | 129          | 129    | 2,394       | 24,564  | メディア        |  |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額    | 8,342  | 9,091       | 97,616  | 1,001,546   |  |
|                                     | 銘柄 数 < 比 率 > | 10     | 10          | -       | < 0.2% >    |  |
| (デンマーク)                             |              |        | 千デンマーククローネ  |         |             |  |
| CARLSBERG B                         | 145          | 162    | 12,198      | 195,299 | 飲料          |  |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B              | 8            | 10     | 6,050       | 96,872  | 海運業         |  |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A           | 5            | 6      | 3,468       | 55,535  | 海運業         |  |
| DANSKE BANK AS                      | 970          | 970    | 7,119       | 113,987 | 銀行          |  |
| GENMAB A/S                          | 84           | 100    | 13,505      | 216,215 | バイオテクノロジー   |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S             | 268          | 298    | 16,229      | 259,827 | 電気設備        |  |
| H LUNDBECK A/S                      | 105          | 105    | 2,025       | 32,427  | 医薬品         |  |
| DSV PANALPINA A S                   | 251          | 325    | 19,805      | 317,086 | 航空貨物・物流サービス |  |
| PANDORA A/S                         | 162          | 160    | 3,433       | 54,971  | 繊維・アパレル・贅沢品 |  |
| CHR HANSEN HOLDING A/S              | 137          | 167    | 8,348       | 133,656 | 化学          |  |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES              | 311          | 337    | 10,312      | 165,098 | 化学          |  |
| COLOPLAST-B                         | 164          | 185    | 17,793      | 284,870 | ヘルスケア機器・用品  |  |

| 銘柄                           | 株数               | 当 期   |         | 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    | 千円      | 千円          |                         |        |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 2,475            | 2,772 | 112,224 | 1,796,712   | 医薬品                     |        |
| ISS A/S                      | 218              | 218   | 1,973   | 31,600      | 商業サービス・用品               |        |
| TRYG A/S                     | 160              | 199   | 3,275   | 52,441      | 保険                      |        |
| ORSTED A/S                   | 254              | 300   | 20,250  | 324,202     | 電力                      |        |
| DEMANT A/S                   | 130              | 160   | 2,342   | 37,501      | ヘルスケア機器・用品              |        |
| 小 計                          | 5,848            | 6,474 | 260,356 | 4,168,307   |                         |        |
|                              | 銘柄数・金額<br>株数<比率> | 17    | 17      | —<br><0.7%> |                         |        |
| (ユーロ…ドイツ)                    |                  |       | 千ユーロ    |             |                         |        |
| ADIDAS AG                    | 246              | 281   | 5,811   | 694,714     | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 576              | 642   | 2,175   | 260,071     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 168              | 168   | 438     | 52,460      | 各種電気通信サービス              |        |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD       | 105              | 105   | 336     | 40,168      | 化学                      |        |
| HANNOVER RUECK SE            | 79               | 96    | 1,237   | 147,935     | 保険                      |        |
| GEA GROUP AG                 | 242              | 242   | 442     | 52,871      | 機械                      |        |
| CONTINENTAL AG               | 154              | 175   | 1,120   | 133,958     | 自動車部品                   |        |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 1,371            | 1,534 | 3,767   | 450,405     | 航空貨物・物流サービス             |        |
| AXEL SPRINGER SE             | 59               | —     | —       | —           | メディア                    |        |
| MERCK KGAA                   | 173              | 199   | 1,781   | 212,924     | 医薬品                     |        |
| RWE AG                       | 720              | 931   | 2,149   | 256,994     | 総合公益事業                  |        |
| SAP SE                       | 1,340            | 1,539 | 15,725  | 1,879,983   | ソフトウェア                  |        |
| E. ON SE                     | 3,070            | 3,550 | 3,389   | 405,177     | 総合公益事業                  |        |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 144              | 163   | 1,052   | 125,883     | 家庭用品                    |        |
| PUMA SE                      | 10               | 126   | 682     | 81,567      | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| BAYER AG-REG                 | 1,273            | 1,543 | 8,128   | 971,765     | 医薬品                     |        |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 246              | 277   | 1,974   | 236,046     | 家庭用品                    |        |
| BASF SE                      | 1,254            | 1,445 | 6,134   | 733,409     | 化学                      |        |
| BEIERSDORF AG                | 137              | 160   | 1,497   | 179,076     | パーソナル用品                 |        |
| HOCHTIEF AG                  | 26               | 38    | 218     | 26,167      | 建設・土木                   |        |
| HEIDELBERGCEMENT AG          | 203              | 226   | 834     | 99,778      | 建設資材                    |        |
| FRESENIUS MEDICAL CARE       | 294              | 333   | 1,950   | 233,207     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| ALLIANZ SE-REG               | 580              | 654   | 9,995   | 1,194,990   | 保険                      |        |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 310              | 420   | 364     | 43,593      | 旅客航空輸送業                 |        |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 207              | 228   | 4,135   | 494,449     | 保険                      |        |
| VOLKSWAGEN AG                | 45               | 51    | 605     | 72,371      | 自動車                     |        |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 252              | 289   | 3,035   | 362,843     | 自動車                     |        |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 1,257            | 1,403 | 3,816   | 456,305     | 自動車                     |        |
| THYSSENKRUPP AG              | 620              | 620   | 287     | 34,355      | 金属・鉱業                   |        |
| SIEMENS AG                   | 1,042            | 1,201 | 9,038   | 1,080,579   | コングロマリット                |        |
| 1&1 DRILLISCH AG             | 80               | —     | —       | —           | 無線通信サービス                |        |
| DEUTSCHE BANK AG-REG         | 2,750            | 3,140 | 1,828   | 218,625     | 資本市場                    |        |
| BAYER MOTOREN WERK           | 449              | 521   | 2,382   | 284,831     | 自動車                     |        |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 78               | 78    | 291     | 34,800      | 自動車                     |        |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG         | 4,600            | 5,180 | 6,208   | 742,255     | 各種電気通信サービス              |        |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 45               | 53    | 1,166   | 139,395     | ヘルスケア機器・用品              |        |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 1,550            | 1,990 | 2,693   | 322,027     | 半導体・半導体製造装置             |        |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR     | —                | 60    | 533     | 63,767      | ヘルスケア機器・用品              |        |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 256              | 295   | 3,702   | 442,603     | 資本市場                    |        |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 203              | 227   | 852     | 101,929     | 自動車                     |        |
| FRAPORT AG                   | 63               | 63    | 232     | 27,799      | 運送インフラ                  |        |
| WIRECARD AG                  | 159              | 180   | 1,798   | 215,060     | 情報技術サービス                |        |
| LANXESS                      | 120              | 120   | 436     | 52,190      | 化学                      |        |
| MTU AERO ENGINES AG          | 69               | 84    | 1,132   | 135,419     | 航空宇宙・防衛                 |        |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           | 484              | 562   | 1,924   | 230,115     | 不動産管理・開発                |        |
| SYMRISE AG                   | 163              | 198   | 1,626   | 194,480     | 化学                      |        |

| 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        |                    |            |
| BRENTAG AG                          | 206     | 238    | 773    | 92,443    | 商社・流通業             |            |
| EVONIK INDUSTRIES AG                | 227     | 330    | 613    | 73,340    | 化学                 |            |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG   | 970     | 1,500  | 329    | 39,361    | 各種電気通信サービス         |            |
| HUGO BOSS AG                        | 93      | —      | —      | —         | 繊維・アパレル・贅沢品        |            |
| COMMERZBANK AG                      | 1,350   | 1,580  | 527    | 63,051    | 銀行                 |            |
| OSRAM LICHT AG                      | 143     | —      | —      | —         | 電気設備               |            |
| KION GROUP AG                       | 99      | 99     | 389    | 46,548    | 機械                 |            |
| VONOVIA SE                          | 664     | 795    | 3,578  | 427,785   | 不動産管理・開発           |            |
| PROSIEBEN SAT. 1 MEDIA SE           | 340     | —      | —      | —         | メディア               |            |
| KNORR-BREMSE AG                     | —       | 71     | 541    | 64,763    | 機械                 |            |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG             | 199     | 239    | 851    | 101,817   | ヘルスケア機器・用品         |            |
| METRO AG                            | 250     | 250    | 178    | 21,393    | 食品・生活必需品小売り        |            |
| INNOGY SE                           | 195     | —      | —      | —         | 総合公益事業             |            |
| ZALANDO SE                          | 171     | 215    | 709    | 84,872    | インターネット販売・通信販売     |            |
| COVESTRO AG                         | 270     | 269    | 736    | 88,019    | 化学                 |            |
| QIAGEN NV                           | 314     | 354    | 1,295  | 154,851   | ライフサイエンス・ツール/サービス  |            |
| UNIPER SE                           | 262     | 311    | 713    | 85,253    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |            |
| DELIVERY HERO SE                    | 119     | 179    | 1,193  | 142,734   | インターネット販売・通信販売     |            |
| 小 計                                 | 株 数     | 金 額    | 33,144 | 37,820    | 131,372            | 15,705,597 |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        | 62      | 58     | —      | < 2.8% >  |                    |            |
| (ユーロ…イタリア)                          |         |        |        |           |                    |            |
| ASSICURAZIONI GENERALI              | 1,620   | 1,750  | 2,163  | 258,691   | 保険                 |            |
| INTESA SANPAOLO                     | 20,620  | 23,300 | 3,426  | 409,693   | 銀行                 |            |
| MEDIOBANCA S. P. A.                 | 880     | 880    | 437    | 52,338    | 銀行                 |            |
| ENEL SPA                            | 11,040  | 12,630 | 8,065  | 964,232   | 電力                 |            |
| ENI SPA                             | 3,450   | 4,030  | 3,462  | 413,999   | 石油・ガス・消耗燃料         |            |
| SNAM SPA                            | 2,980   | 3,200  | 1,323  | 158,226   | ガス                 |            |
| TENARIS SA                          | 600     | 710    | 393    | 47,006    | エネルギー設備・サービス       |            |
| TELECOM ITALIA SPA                  | 15,300  | 15,500 | 558    | 66,727    | 各種電気通信サービス         |            |
| TELECOM ITALIA-RNC                  | 8,800   | 8,800  | 315    | 37,747    | 各種電気通信サービス         |            |
| ATLANTIA SPA                        | 700     | 790    | 841    | 100,630   | 運送インフラ             |            |
| TERNA SPA                           | 1,850   | 2,220  | 1,281  | 153,242   | 電力                 |            |
| RECORDATI SPA                       | 141     | 168    | 657    | 78,590    | 医薬品                |            |
| LEONARDO SPA                        | 550     | 640    | 381    | 45,631    | 航空宇宙・防衛            |            |
| PRYSMIAN SPA                        | 309     | 370    | 566    | 67,743    | 電気設備               |            |
| FERRARI NV                          | 171     | 189    | 2,629  | 314,408   | 自動車                |            |
| CNH INDUSTRIAL NV                   | 1,410   | 1,540  | 790    | 94,520    | 機械                 |            |
| MONCLER SPA                         | 252     | 281    | 955    | 114,218   | 繊維・アパレル・贅沢品        |            |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA         | —       | 910    | 766    | 91,623    | 銀行                 |            |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV        | 1,500   | 1,700  | 1,072  | 128,241   | 自動車                |            |
| UNICREDIT SPA                       | 2,710   | 3,130  | 2,276  | 272,186   | 銀行                 |            |
| EXOR NV                             | 151     | 172    | 803    | 96,089    | 各種金融サービス           |            |
| POSTE ITALIANE SPA                  | 770     | 770    | 609    | 72,869    | 保険                 |            |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA           | 760     | 910    | 605    | 72,345    | 飲料                 |            |
| PIRELLI & C. SPA                    | 530     | 530    | 177    | 21,169    | 自動車部品              |            |
| 小 計                                 | 株 数     | 金 額    | 77,094 | 85,120    | 34,564             | 4,132,174  |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        | 23      | 24     | —      | < 0.7% >  |                    |            |
| (ユーロ…フランス)                          |         |        |        |           |                    |            |
| BOUYGUES                            | 314     | 348    | 958    | 114,534   | 建設・土木              |            |
| AIRBUS SE                           | 793     | 918    | 5,593  | 668,687   | 航空宇宙・防衛            |            |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 710     | 820    | 1,617  | 193,366   | 総合公益事業             |            |
| LOREAL-ORD                          | 344     | 394    | 9,704  | 1,160,139 | パーソナル用品            |            |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 378     | 435    | 15,239 | 1,821,822 | 繊維・アパレル・贅沢品        |            |
| DASSAULT AVIATION SA                | 3       | 3      | 232    | 27,813    | 航空宇宙・防衛            |            |

| 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…フランス)                   | 百株      | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |                |
| THALES SA                    | 141     | 163   | 1,189  | 142,252   | 航空宇宙・防衛        |
| CAPGEMINI SA                 | 219     | 245   | 1,911  | 228,460   | 情報技術サービス       |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA | 83      | 83    | 289    | 34,580    | 食品・生活必需品小売り    |
| INGENICO GROUP               | 81      | 95    | 902    | 107,939   | 電子装置・機器・部品     |
| PUBLICIS GROUPE              | 292     | 321   | 748    | 89,530    | メディア           |
| FAURECIA                     | 105     | 105   | 281    | 33,628    | 自動車部品          |
| BOLLORE                      | 1,060   | 1,380 | 332    | 39,759    | 娯楽             |
| MICHELIN (CGDE)              | 238     | 267   | 2,042  | 244,123   | 自動車部品          |
| PERNOD RICARD SA             | 291     | 335   | 4,380  | 523,643   | 飲料             |
| RENAULT SA                   | 255     | 281   | 483    | 57,807    | 自動車            |
| REMY COINTREAU               | 30      | 40    | 408    | 48,776    | 飲料             |
| SEB SA                       | 30      | 38    | 405    | 48,518    | 家庭用耐久財         |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 754     | 869   | 6,884  | 823,008   | 電気設備           |
| VIVENDI SA                   | 1,437   | 1,300 | 2,363  | 282,544   | 娯楽             |
| ORANGE SA                    | 2,770   | 3,120 | 3,497  | 418,128   | 各種電気通信サービス     |
| HERMES INTERNATIONAL         | 44      | 50    | 3,205  | 383,205   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| SOCIETE BIC SA               | 38      | —     | —      | —         | 商業サービス・用品      |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 178     | 209   | 2,777  | 332,063   | ソフトウェア         |
| KERING SA                    | 105     | 117   | 5,676  | 678,671   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| CNP ASSURANCES               | 212     | 280   | 244    | 29,189    | 保険             |
| CARREFOUR SUPERMARCHE        | 800     | 950   | 1,349  | 161,386   | 食品・生活必需品小売り    |
| ATOS SE                      | 136     | 153   | 918    | 109,783   | 情報技術サービス       |
| SANOFI                       | 1,536   | 1,767 | 14,226 | 1,700,732 | 医薬品            |
| ACCOR SA                     | 262     | 262   | 653    | 78,179    | ホテル・レストラン・レジャー |
| STMICROELECTRONICS NV        | 970     | 1,050 | 2,037  | 243,523   | 半導体・半導体製造装置    |
| SOCIETE GENERALE             | 1,043   | 1,270 | 1,960  | 234,362   | 銀行             |
| TELEPERFORMANCE              | 77      | 90    | 1,618  | 193,455   | 専門サービス         |
| EURAZEO SE                   | 56      | 59    | 244    | 29,264    | 各種金融サービス       |
| SODEXO                       | 121     | 132   | 785    | 93,863    | ホテル・レストラン・レジャー |
| AXA                          | 2,650   | 3,010 | 4,619  | 552,218   | 保険             |
| PEUGEOT CITROEN              | 820     | 880   | 1,035  | 123,825   | 自動車            |
| JC DECAUX SA                 | 93      | 150   | 235    | 28,100    | メディア           |
| ESSILORLUXOTTICA             | 399     | 439   | 4,364  | 521,780   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 1,540   | 1,840 | 1,232  | 147,337   | 銀行             |
| BNP PARIBAS                  | 1,529   | 1,739 | 4,912  | 587,310   | 銀行             |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)   | 669     | 790   | 1,694  | 202,536   | 建設関連製品         |
| WENDEL                       | 34      | 43    | 316    | 37,886    | 各種金融サービス       |
| ILIAD SA                     | 39      | 24    | 305    | 36,481    | 各種電気通信サービス     |
| SES FDR                      | 480     | 560   | 294    | 35,201    | メディア           |
| IMERYS                       | 38      | —     | —      | —         | 建設資材           |
| SAFRAN SA                    | 457     | 508   | 4,312  | 515,609   | 航空宇宙・防衛        |
| ENGIE                        | 2,510   | 2,900 | 2,740  | 327,626   | 総合公益事業         |
| ALSTOM                       | 205     | 303   | 1,129  | 135,077   | 機械             |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 241     | 241   | 218    | 26,120    | メディア           |
| ELECTRICITE DE FRANCE        | 820     | 940   | 653    | 78,169    | 電力             |
| IPSEN                        | 55      | 55    | 259    | 31,048    | 医薬品            |
| ARKEMA                       | 99      | 99    | 596    | 71,320    | 化学             |
| LEGRAND SA                   | 370     | 410   | 2,360  | 282,231   | 電気設備           |
| EIFFAGE SA                   | 108     | 121   | 798    | 95,472    | 建設・土木          |
| TOTAL SA                     | 3,294   | 3,762 | 12,629 | 1,509,801 | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ADP                          | 39      | 47    | 416    | 49,783    | 運送インフラ         |
| NATIXIS                      | 1,280   | 1,580 | 492    | 58,914    | 資本市場           |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 111     | 144   | 985    | 117,786   | 娯楽             |
| SCOR SE                      | 232     | 232   | 465    | 55,637    | 保険             |

| 銘柄                                   | 株数               | 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…フランス)                           | 百株               | 百株           | 千ユーロ         | 千円           |                      |                   |
| REXEL SA                             | 450              | —            | —            | —            |                      | 商社・流通業            |
| VINCI                                | 702              | 810          | 5,913        | 706,899      |                      | 建設・土木             |
| DANONE                               | 844              | 972          | 5,552        | 663,749      |                      | 食品                |
| AIR LIQUIDE SA                       | 592              | 734          | 8,264        | 988,061      |                      | 化学                |
| BUREAU VERITAS SA                    | 342              | 470          | 799          | 95,520       |                      | 専門サービス            |
| GETLINK                              | 620              | 720          | 770          | 92,101       |                      | 運送インフラ            |
| SUEZ                                 | 520              | 520          | 493          | 59,032       |                      | 総合公益事業            |
| EDENRED                              | 328              | 382          | 1,452        | 173,630      |                      | 情報技術サービス          |
| VALEO SA                             | 331              | 373          | 540          | 64,658       |                      | 自動車部品             |
| BIOMERIEUX                           | 59               | 69           | 691          | 82,654       |                      | ヘルスケア機器・用品        |
| WORLDLINE SA                         | —                | 198          | 1,070        | 127,941      |                      | 情報技術サービス          |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH             | 41               | 41           | 732          | 87,541       |                      | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AMUNDI SA                            | 82               | 100          | 529          | 63,301       |                      | 資本市場              |
| 小 計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 38,931<br>72 | 44,157<br>70 | 169,043<br>— | 20,209,116<br><3.6%> |                   |
| (ユーロ…オランダ)                           |                  |              |              |              |                      |                   |
| RANDSTAD NV                          | 174              | 184          | 571          | 68,367       |                      | 専門サービス            |
| WOLTERS KLUWER                       | 390              | 418          | 2,606        | 311,624      |                      | 専門サービス            |
| VOPAK                                | 90               | 114          | 533          | 63,727       |                      | 石油・ガス・消耗燃料        |
| AEGON NV                             | 2,460            | 2,930        | 684          | 81,825       |                      | 保険                |
| KONINKLIJKE KPN NV                   | 4,460            | 5,600        | 1,201        | 143,603      |                      | 各種電気通信サービス        |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV               | 1,259            | 1,426        | 5,233        | 625,655      |                      | ヘルスケア機器・用品        |
| HEINEKEN NV                          | 357              | 400          | 2,920        | 349,181      |                      | 飲料                |
| HEINEKEN HOLDING NV                  | 160              | 172          | 1,158        | 138,489      |                      | 飲料                |
| KONINKLIJKE DSM NV                   | 247              | 285          | 2,958        | 353,664      |                      | 化学                |
| UNILEVER NV-CVA                      | 2,102            | —            | —            | —            |                      | パーソナル用品           |
| UNILEVER NV                          | —                | 2,276        | 9,957        | 1,190,419    |                      | パーソナル用品           |
| ASML HOLDING NV                      | 560              | 666          | 16,317       | 1,950,755    |                      | 半導体・半導体製造装置       |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV        | 1,606            | 1,706        | 3,665        | 438,191      |                      | 食品・生活必需品小売り       |
| AKZO NOBEL                           | 310              | 324          | 2,002        | 239,377      |                      | 化学                |
| PROSUS NV                            | —                | 768          | 4,798        | 573,656      |                      | インターネット販売・通信販売    |
| NN GROUP NV                          | 429              | 470          | 1,148        | 137,268      |                      | 保険                |
| ARCELORMITTAL                        | 885              | 990          | 789          | 94,387       |                      | 金属・鉱業             |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV             | —                | 175          | 1,193        | 142,682      |                      | インターネット販売・通信販売    |
| ABN AMRO BANK NV-CVA                 | 581              | 700          | 513          | 61,424       |                      | 銀行                |
| ALTICE EUROPE N.V.                   | —                | 990          | 340          | 40,666       |                      | メディア              |
| ADYEN NV                             | 14               | 16           | 1,293        | 154,610      |                      | 情報技術サービス          |
| ING GROEP NV                         | 5,280            | 6,170        | 3,080        | 368,258      |                      | 銀行                |
| 小 計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 21,365<br>18 | 26,781<br>21 | 62,968<br>—  | 7,527,838<br><1.4%>  |                   |
| (ユーロ…スペイン)                           |                  |              |              |              |                      |                   |
| ENDESA S.A.                          | 444              | 500          | 969          | 115,903      |                      | 電力                |
| BANKINTER S.A.                       | 880              | 910          | 286          | 34,279       |                      | 銀行                |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | 9,230            | 10,560       | 3,083        | 368,634      |                      | 銀行                |
| NATURGY ENERGY GROUP SA              | 493              | 490          | 773          | 92,467       |                      | ガス                |
| REPSOL SA                            | 1,882            | 2,204        | 1,673        | 200,116      |                      | 石油・ガス・消耗燃料        |
| BANCO SANTANDER SA                   | 22,110           | 26,140       | 5,788        | 692,039      |                      | 銀行                |
| TELEFONICA SA                        | 6,400            | 7,320        | 3,029        | 362,118      |                      | 各種電気通信サービス        |
| ENAGAS SA                            | 304              | 390          | 697          | 83,411       |                      | ガス                |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA   | 300              | 380          | 513          | 61,329       |                      | 電気設備              |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV         | 350              | 403          | 658          | 78,666       |                      | 建設・土木             |
| FERROVIAL SA                         | 665              | 770          | 1,650        | 197,362      |                      | 建設・土木             |
| MAPPRE SA                            | 1,630            | 1,630        | 254          | 30,389       |                      | 保険                |
| BANCO DE SABADELL SA                 | 7,900            | 8,019        | 365          | 43,707       |                      | 銀行                |

| 銘柄                               | 株数      | 株数     | 期末     |           | 業種等               |  |
|----------------------------------|---------|--------|--------|-----------|-------------------|--|
|                                  |         |        | 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        |                   |  |
| CAIXABANK                        | 5,050   | 5,300  | 885    | 105,908   | 銀行                |  |
| IBERDROLA SA                     | 8,586   | 9,660  | 8,413  | 1,005,876 | 電力                |  |
| AMADEUS IT GROUP SA              | 595     | 667    | 2,910  | 347,904   | 情報技術サービス          |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA     | 590     | 700    | 1,184  | 141,636   | 電力                |  |
| INDITEX SA                       | 1,480   | 1,680  | 3,815  | 456,116   | 専門小売り             |  |
| AENA SME SA                      | 93      | 107    | 1,073  | 128,302   | 運送インフラ            |  |
| CELLNEX TELECOM SA               | —       | 386    | 1,638  | 195,844   | 各種電気通信サービス        |  |
| GRIFOLS SA                       | 401     | 468    | 1,452  | 173,610   | バイオテクノロジー         |  |
| BANKIA SA                        | 1,510   | 1,510  | 157    | 18,864    | 銀行                |  |
| 小計                               | 株数・金額   | 70,894 | 80,196 | 41,275    | 4,934,493         |  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 21     | 22     | —         | <0.9%>            |  |
| (ユーロ…ベルギー)                       |         |        |        |           |                   |  |
| KBC GROEP NV                     | 346     | 382    | 1,542  | 184,362   | 銀行                |  |
| SOLVAY SA                        | 103     | 114    | 745    | 89,077    | 化学                |  |
| UCB SA                           | 165     | 195    | 1,472  | 176,054   | 医薬品               |  |
| COLRUYT SA                       | 87      | 87     | 427    | 51,068    | 食品・生活必需品小売り       |  |
| GROUPE BRUXELLES LAM             | 110     | 124    | 871    | 104,184   | 各種金融サービス          |  |
| PROXIMUS                         | 216     | 260    | 562    | 67,263    | 各種電気通信サービス        |  |
| GALAPAGOS NV                     | —       | 70     | 1,221  | 145,988   | バイオテクノロジー         |  |
| TELENET GROUP HOLDING NV         | 67      | 67     | 190    | 22,828    | メディア              |  |
| AGEAS                            | 258     | 289    | 1,013  | 121,166   | 保険                |  |
| UMICORE                          | 280     | 310    | 952    | 113,812   | 化学                |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV       | 1,036   | 1,201  | 4,672  | 558,596   | 飲料                |  |
| 小計                               | 株数・金額   | 2,668  | 3,099  | 13,671    | 1,634,401         |  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 10     | 11     | —         | <0.3%>            |  |
| (ユーロ…オーストリア)                     |         |        |        |           |                   |  |
| OMV AG                           | 210     | 210    | 527    | 63,090    | 石油・ガス・消耗燃料        |  |
| VERBUND AG                       | 90      | 110    | 357    | 42,712    | 電力                |  |
| VOESTALPINE AG                   | 165     | 200    | 360    | 43,038    | 金属・鉱業             |  |
| ERSTE GROUP BANK AG              | 400     | 480    | 819    | 97,954    | 銀行                |  |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 201     | 201    | 276    | 33,028    | 銀行                |  |
| ANDRITZ AG                       | 92      | 117    | 320    | 38,353    | 機械                |  |
| 小計                               | 株数・金額   | 1,158  | 1,318  | 2,661     | 318,177           |  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 6      | 6      | —         | <0.1%>            |  |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)                    |         |        |        |           |                   |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE           | 14      | 17     | 719    | 85,968    | ライフサイエンス・ツール/サービス |  |
| RTL GROUP                        | 54      | —      | —      | —         | メディア              |  |
| AROUNDTOWN SA                    | 1,070   | 1,850  | 798    | 95,433    | 不動産管理・開発          |  |
| 小計                               | 株数・金額   | 1,138  | 1,867  | 1,517     | 181,402           |  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 3      | 2      | —         | <0.0%>            |  |
| (ユーロ…フィンランド)                     |         |        |        |           |                   |  |
| WARTSILA OYJ                     | 630     | 630    | 406    | 48,594    | 機械                |  |
| UPM-KYMMENE OYJ                  | 733     | 832    | 1,941  | 232,152   | 紙製品・林産品           |  |
| STORA ENSO OYJ-R                 | 730     | 850    | 747    | 89,342    | 紙製品・林産品           |  |
| SAMPO OYJ-A SHS                  | 612     | 682    | 1,756  | 209,947   | 保険                |  |
| FORTUM OYJ                       | 600     | 720    | 943    | 112,845   | 電力                |  |
| ELISA OYJ                        | 195     | 221    | 1,217  | 145,524   | 各種電気通信サービス        |  |
| METSO OYJ                        | 162     | 162    | 334    | 39,934    | 機械                |  |
| NOKIA OYJ                        | 7,810   | 8,800  | 2,409  | 287,995   | 通信機器              |  |
| NESTE OYJ                        | 176     | 668    | 1,881  | 224,963   | 石油・ガス・消耗燃料        |  |
| NOKIAN RENKAAT OYJ               | 158     | 210    | 393    | 47,047    | 自動車部品             |  |
| KONE OYJ                         | 456     | 540    | 2,732  | 326,658   | 機械                |  |

| 銘柄                                     | 株数      | 期首(前期末) |         | 当期      |            | 業種等            |
|--|---------|---------|---------|---------|------------|----------------|
|  |         | 株数      | 株数      | 評価額     |            |                |
|  |         |         |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                |
| (ユーロ…フィンランド)                           | 百株      | 百株      | 千ユーロ    | 千円      |            |                |
| ORION OYJ                              | 130     | 165     | 603     | 72,117  |            | 医薬品            |
| 小計                                     | 株数・金額   | 12,392  | 14,480  | 15,367  | 1,837,125  |                |
|  | 銘柄数<比率> | 12      | 12      | —       | <0.3%>     |                |
| (ユーロ…アイルランド)                           |         |         |         |         |            |                |
| CRH PLC                                | 1,136   | 1,253   | 2,927   | 349,923 |            | 建設資材           |
| KINGSPAN GROUP PLC                     | 222     | 245     | 1,127   | 134,732 |            | 建設関連製品         |
| KERRY GROUP PLC-A                      | 221     | 244     | 2,508   | 299,869 |            | 食品             |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD         | 1,398   | 1,398   | —       | —       |            | 銀行             |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC                | 320     | 353     | 869     | 103,899 |            | 容器・包装          |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC              | 1,330   | 1,330   | 238     | 28,508  |            | 銀行             |
| AIB GROUP PLC                          | 1,250   | 1,250   | 126     | 15,108  |            | 銀行             |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC              | 119     | 121     | 891     | 106,611 |            | ホテル・レストラン・レジャー |
| 小計                                     | 株数・金額   | 5,996   | 6,194   | 8,688   | 1,038,653  |                |
|  | 銘柄数<比率> | 8       | 8       | —       | <0.2%>     |                |
| (ユーロ…ポルトガル)                            |         |         |         |         |            |                |
| ENERGIAS DE PORTUGAL                   | 3,610   | 3,870   | 1,371   | 163,966 |            | 電力             |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS            | 670     | 810     | 808     | 96,641  |            | 石油・ガス・消耗燃料     |
| JERONIMO MARTINS                       | 310     | 380     | 608     | 72,686  |            | 食品・生活必需品小売り    |
| 小計                                     | 株数・金額   | 4,590   | 5,060   | 2,787   | 333,294    |                |
|  | 銘柄数<比率> | 3       | 3       | —       | <0.1%>     |                |
| ユーロ計                                   | 株数・金額   | 269,371 | 306,092 | 483,916 | 57,852,275 |                |
|  | 銘柄数<比率> | 238     | 237     | —       | <10.4%>    |                |
| (香港)                                   |         |         |         | 千香港ドル   |            |                |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY                 | 380     | 480     | 3,288   | 46,163  |            | 半導体・半導体製造装置    |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD               | 2,510   | 3,100   | 4,588   | 64,415  |            | 不動産管理・開発       |
| BANK OF EAST ASIA                      | 1,670   | 2,200   | 3,573   | 50,175  |            | 銀行             |
| CLP HLDGS                              | 2,270   | 2,530   | 17,760  | 249,358 |            | 電力             |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD     | 1,624   | 1,887   | 43,778  | 614,648 |            | 資本市場           |
| MTR CORP                               | 2,010   | 2,430   | 9,598   | 134,762 |            | 陸運・鉄道          |
| HANG LUNG GROUP LTD                    | 1,030   | —       | —       | —       |            | 不動産管理・開発       |
| HANG SENG BANK                         | 1,058   | 1,190   | 15,589  | 218,869 |            | 銀行             |
| HENDERSON LAND                         | 1,858   | 2,294   | 6,607   | 92,775  |            | 不動産管理・開発       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD              | 1,910   | 2,250   | 10,260  | 144,050 |            | 電力             |
| WHARF(HOLDING)                         | 1,740   | —       | —       | —       |            | 不動産管理・開発       |
| HONG KONG & CHINA GAS                  | 12,403  | 15,603  | 18,911  | 265,516 |            | ガス             |
| HYSAN DEVELOPMENT                      | 830     | —       | —       | —       |            | 不動産管理・開発       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L           | 3,330   | 3,350   | 13,601  | 190,958 |            | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY PROPERTIES                       | 790     | 1,140   | 2,184   | 30,666  |            | 不動産管理・開発       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD             | 4,950   | 5,690   | 12,005  | 168,562 |            | 銀行             |
| NWS HOLDINGS LTD                       | 2,205   | 2,205   | 1,664   | 23,373  |            | コングロマリット       |
| PCCW LTD                               | 5,500   | 7,500   | 3,135   | 44,015  |            | 各種電気通信サービス     |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG               | 970     | 970     | 1,138   | 15,988  |            | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEW WORLD DEVELOPMENT                  | 8,396   | 9,396   | 7,658   | 107,522 |            | 不動産管理・開発       |
| SHANGRI-LA ASIA LTD                    | 1,603   | —       | —       | —       |            | ホテル・レストラン・レジャー |
| SINO LAND CO.LTD                       | 4,800   | 4,800   | 4,396   | 61,731  |            | 不動産管理・開発       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES                | 2,170   | 2,480   | 24,552  | 344,710 |            | 不動産管理・開発       |
| SWIRE PACIFIC-A                        | 640     | 750     | 3,648   | 51,228  |            | 不動産管理・開発       |
| VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED | —       | 1,300   | 3,016   | 42,344  |            | 食品             |
| WHEELOK & COMPANY LTD                  | 1,170   | 1,340   | 6,934   | 97,360  |            | 不動産管理・開発       |
| TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED  | 1,950   | 2,120   | 10,366  | 145,549 |            | 機械             |
| MINH GROUP LTD                         | 1,120   | —       | —       | —       |            | 自動車部品          |
| SJM HOLDINGS LIMITED                   | 2,700   | 2,700   | 1,741   | 24,450  |            | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN MACAU LTD                         | 2,280   | 2,280   | 2,708   | 38,029  |            | ホテル・レストラン・レジャー |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD                 | 1,240   | —       | —       | —       |            | ホテル・レストラン・レジャー |

| 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 |
| (香港)                                 | 百株           | 百株      | 千香港ドル     | 千円        |                         |        |
| ATA GROUP LTD                        | 16,470       | 18,930  | 129,007   | 1,811,271 | 保険                      |        |
| HKT TRUST AND HKT LTD                | 5,196        | 5,996   | 6,259     | 87,887    | 各種電気通信サービス              |        |
| SANDS CHINA LTD                      | 3,360        | 3,840   | 10,752    | 150,958   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| SWIRE PROPERTIES LTD                 | 1,730        | 1,730   | 3,607     | 50,642    | 不動産管理・開発                |        |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT         | 1,640        | 1,830   | 5,572     | 78,235    | 不動産管理・開発                |        |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT         | —            | 2,160   | 4,315     | 60,592    | 飲料                      |        |
| WH GROUP LIMITED                     | 11,700       | 14,600  | 10,278    | 144,308   | 食品                      |        |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD            | 3,710        | 4,250   | 21,868    | 307,031   | コンピュータソフト               |        |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD       | 890          | 1,070   | 4,242     | 59,565    | 電力                      |        |
| CK ASSET HOLDINGS LTD                | 3,610        | 4,090   | 16,647    | 233,736   | 不動産管理・開発                |        |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 125,416 | 140,483   | 445,260   | 6,251,459               |        |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 39      | 35        | —         | < 1.1% >                |        |
| (シンガポール)                             |              |         | 千シンガポールドル |           |                         |        |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING           | 1,980        | 2,490   | 739       | 56,477    | 航空宇宙・防衛                 |        |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD            | 9,400        | —       | —         | —         | 食品                      |        |
| DBS GROUP HLDGS                      | 2,430        | 2,840   | 5,197     | 396,910   | 銀行                      |        |
| CITY DEVELOPMENTS LTD                | 510          | 700     | 490       | 37,421    | 不動産管理・開発                |        |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD           | 140          | 140     | 265       | 20,282    | 販売                      |        |
| SATS LTD                             | 770          | 1,150   | 368       | 28,104    | 運送インフラ                  |        |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 1,110        | 1,290   | 1,150     | 87,877    | 資本市場                    |        |
| CAPITALAND LIMITED                   | 3,300        | 3,800   | 1,048     | 80,096    | 不動産管理・開発                |        |
| COMFORTDELGRO CORP LTD               | 3,100        | 3,100   | 458       | 35,038    | 陸運・鉄道                   |        |
| SINGAPORE AIRLINES LTD               | 770          | 770     | 446       | 34,124    | 旅客航空輸送業                 |        |
| UNITED OVERSEAS BANK                 | 1,850        | 2,000   | 3,842     | 293,413   | 銀行                      |        |
| UOL GROUP LIMITED                    | 650          | 650     | 416       | 31,819    | 不動産管理・開発                |        |
| VENTURE CORP LTD                     | 350          | 450     | 594       | 45,363    | 電子装置・機器・部品              |        |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS             | 2,400        | 2,400   | 424       | 32,441    | メディア                    |        |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 11,100       | 12,900  | 3,121     | 238,411   | 各種電気通信サービス              |        |
| SEBPCORP INDUSTRIES                  | 1,400        | 1,400   | 219       | 16,790    | コンピュータソフト               |        |
| OCBC-ORD                             | 4,330        | 5,240   | 4,464     | 340,952   | 銀行                      |        |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD             | 2,470        | 2,890   | 887       | 67,757    | 食品                      |        |
| KEPPEL CORP.                         | 2,020        | 2,320   | 1,215     | 92,841    | コンピュータソフト               |        |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING             | 3,800        | 4,400   | 365       | 27,890    | 機械                      |        |
| GENTING SINGAPORE LTD                | 8,700        | 8,700   | 556       | 42,522    | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 62,581  | 59,630    | 26,273    | 2,006,539               |        |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 21      | 20        | —         | < 0.4% >                |        |
| (オーストラリア)                            |              |         | 千豪ドル      |           |                         |        |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD               | 205          | 250     | 1,458     | 96,375    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK         | 3,930        | 4,390   | 7,366     | 486,846   | 銀行                      |        |
| AMCOR PLC-CDI                        | 1,550        | —       | —         | —         | 容器・包装                   |        |
| WESTPAC BANKING CORP                 | 4,690        | 5,630   | 9,098     | 601,292   | 銀行                      |        |
| BANK OF QUEENSLAND LTD               | 560          | —       | —         | —         | 銀行                      |        |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           | 2,230        | 2,190   | 2,211     | 146,184   | 金属・鉱業                   |        |
| TELSTRA CORP LTD                     | 5,900        | 6,500   | 2,112     | 139,615   | 各種電気通信サービス              |        |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD        | 670          | 920     | 592       | 39,157    | 銀行                      |        |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 | 770          | 770     | 668       | 44,171    | 飲料                      |        |
| ASX LTD                              | 263          | 307     | 2,379     | 157,244   | 資本市場                    |        |
| BHP GROUP LIMITED                    | 4,010        | 4,580   | 13,831    | 914,130   | 金属・鉱業                   |        |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED             | 333          | 400     | 892       | 58,952    | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD           | 971          | 971     | 295       | 19,512    | 複合小売り                   |        |
| COMPUTERSHARE LTD                    | 630          | 760     | 737       | 48,771    | 情報技術サービス                |        |
| CSL LIMITED                          | 618          | 712     | 22,262    | 1,471,349 | バイオテクノロジー               |        |
| REA GROUP LTD                        | 69           | 88      | 714       | 47,225    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |        |
| TRANSURBAN GROUP                     | 3,720        | 4,340   | 5,273     | 348,499   | 運送インフラ                  |        |

| 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)                                | 百株          | 百株    | 千豪ドル        | 千円        |                         |            |
| COCHLEAR LTD                             | 81          | 89    | 1,627       | 107,529   | ヘルスケア機器・用品              |            |
| ORIGIN ENERGY LTD                        | 2,390       | 2,650 | 1,173       | 77,586    | 石油・ガス・消耗燃料              |            |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA           | 2,424       | 2,778 | 17,765      | 1,174,109 | 銀行                      |            |
| BORAL LTD                                | 1,530       | 2,000 | 404         | 26,700    | 建設資材                    |            |
| RIO TINTO LTD                            | 512         | 575   | 5,033       | 332,667   | 金属・鉱業                   |            |
| APA GROUP                                | 1,590       | 1,800 | 1,873       | 123,839   | ガス                      |            |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD                   | 760         | 880   | 1,899       | 125,565   | ホテル・レストラン・レジャー          |            |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD            | 3,080       | 3,610 | 2,310       | 152,694   | 保険                      |            |
| TPG TELECOM LTD                          | 520         | 520   | 369         | 24,400    | 各種電気通信サービス              |            |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD           | 73          | 73    | 72          | 4,781     | ホテル・レストラン・レジャー          |            |
| ORICA LTD                                | 500         | 590   | 962         | 63,597    | 化学                      |            |
| BLUESCOPE STEEL LTD                      | 680         | 880   | 806         | 53,273    | 金属・鉱業                   |            |
| WORLEY LTD                               | 470         | 470   | 280         | 18,513    | エネルギー設備・サービス            |            |
| SUNCORP GROUP LTD                        | 1,810       | 1,903 | 1,731       | 114,459   | 保険                      |            |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK                  | 3,710       | 4,560 | 7,437       | 491,535   | 銀行                      |            |
| NEWCREST MINING                          | 1,030       | 1,170 | 2,867       | 189,524   | 金属・鉱業                   |            |
| OIL SEARCH LTD                           | 1,790       | 2,040 | 475         | 31,413    | 石油・ガス・消耗燃料              |            |
| INCITEC PIVOT LTD                        | 2,330       | 2,330 | 456         | 30,181    | 化学                      |            |
| AMP LIMITED                              | 3,900       | 5,300 | 707         | 46,761    | 各種金融サービス                |            |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED                   | —           | 1,080 | 345         | 22,840    | 旅客航空輸送業                 |            |
| QBE INSURANCE                            | 1,790       | 1,950 | 1,677       | 110,832   | 保険                      |            |
| CHALLENGER LIMITED                       | 800         | 800   | 321         | 21,254    | 各種金融サービス                |            |
| SANTOS LTD.                              | 2,320       | 2,610 | 882         | 58,303    | 石油・ガス・消耗燃料              |            |
| SONIC HEALTHCARE LTD                     | 620         | 690   | 1,689       | 111,633   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |            |
| WASHINGTON H. SOUL PATINSON              | 170         | 170   | 299         | 19,774    | 石油・ガス・消耗燃料              |            |
| TABCORP HOLDINGS                         | 2,470       | 3,400 | 833         | 55,052    | ホテル・レストラン・レジャー          |            |
| WESFARMERS LIMITED                       | 1,540       | 1,750 | 6,280       | 415,094   | 複合小売り                   |            |
| ALUMINA LTD                              | 3,500       | 3,500 | 549         | 36,316    | 金属・鉱業                   |            |
| WOODSIDE PETROLEUM                       | 1,270       | 1,520 | 2,731       | 180,520   | 石油・ガス・消耗燃料              |            |
| WOOLWORTHS GROUP LTD                     | 1,810       | 1,970 | 7,513       | 496,572   | 食品・生活必需品小売り             |            |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD             | —           | 192   | 810         | 53,574    | 資本市場                    |            |
| SEEK LTD                                 | 480         | 480   | 717         | 47,394    | 専門サービス                  |            |
| DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L             | 85          | —     | —           | —         | ホテル・レストラン・レジャー          |            |
| BRAMBLES LTD                             | 2,180       | 2,510 | 2,663       | 176,004   | 商業サービス・用品               |            |
| MACQUARIE GROUP LIMITED                  | 439         | 530   | 4,539       | 300,012   | 資本市場                    |            |
| CROWN RESORTS LTD                        | 550         | 550   | 396         | 26,171    | ホテル・レストラン・レジャー          |            |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC              | 580         | 670   | 1,255       | 82,981    | 建設資材                    |            |
| TREASURY WINE ESTATES LTD                | 1,000       | 1,110 | 1,091       | 72,112    | 飲料                      |            |
| SYDNEY AIRPORT                           | 1,440       | 1,680 | 999         | 66,063    | 運送インフラ                  |            |
| AURIZON HOLDINGS LTD                     | 2,730       | 3,050 | 1,473       | 97,360    | 陸運・鉄道                   |            |
| AUSNET SERVICES                          | 2,300       | 3,300 | 572         | 37,839    | 電力                      |            |
| MEDIBANK PRIVATE LTD                     | 3,500       | 4,500 | 1,269       | 83,868    | 保険                      |            |
| AGL ENERGY LTD                           | 930         | 1,050 | 1,782       | 117,831   | 総合公益事業                  |            |
| SOUTH32 LTD                              | 7,000       | 7,800 | 1,450       | 95,883    | 金属・鉱業                   |            |
| CIMIC GROUP LTD                          | 117         | 180   | 411         | 27,182    | 建設・土木                   |            |
| COLES GROUP LTD                          | 1,610       | 1,760 | 2,960       | 195,647   | 食品・生活必需品小売り             |            |
| WISETECH GLOBAL LTD                      | —           | 210   | 332         | 21,998    | ソフトウェア                  |            |
| 小 計                                      | 株 数         | 金 額   | 101,530     | 116,038   | 163,997                 | 10,838,587 |
|  | 銘柄 数 < 比率 > |       | 61          | 61        | —                       | < 1.9% >   |
| (ニュージーランド)                               |             |       | 千ニュージーランドドル |           |                         |            |
| RYMAN HEALTHCARE LTD                     | 580         | 580   | 593         | 38,424    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |            |
| A2 MILK CO LTD                           | 1,060       | 1,170 | 1,979       | 128,201   | 食品                      |            |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L | 740         | 860   | 2,610       | 169,030   | ヘルスケア機器・用品              |            |
| FLETCHER BUILDING LTD                    | 1,126       | 1,500 | 480         | 31,084    | 建設資材                    |            |

| 銘柄                           | 期首(前期末)      |           | 当 期 末       |         | 業 種 等              |
|------------------------------|--------------|-----------|-------------|---------|--------------------|
|                              | 株 数          | 株 数       | 評 価 額       | 評 価 額   |                    |
|                              |              |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |                    |
| (ニュージーランド)                   | 百株           | 百株        | 千ニュージーランドドル | 千円      |                    |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 2,600        | 3,070     | 1,252       | 81,115  | 各種電気通信サービス         |
| MERCURY NZ LTD               | —            | 1,000     | 424         | 27,458  | 電力                 |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 1,300        | 1,520     | 796         | 51,580  | 運送インフラ             |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | 1,590        | 2,010     | 810         | 52,457  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 8,996     | 11,710      | 8,946   | 579,352            |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 7         | 8           | —       | < 0.1% >           |
| (イスラエル)                      |              |           | 千新シエケル      |         |                    |
| BANK HAPOALIM BM             | 1,410        | 1,830     | 3,806       | 115,942 | 銀行                 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 2,140        | 2,380     | 4,522       | 137,740 | 銀行                 |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP | 2,800        | —         | —           | —       | 各種電気通信サービス         |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | 36           | 36        | 1,641       | 50,003  | 航空宇宙・防衛            |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A       | —            | 1,720     | 1,752       | 53,386  | 銀行                 |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED     | 910          | 1,250     | 1,368       | 41,692  | 化学                 |
| NICE LTD                     | 86           | 95        | 5,147       | 156,780 | ソフトウェア             |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 170          | 230       | 1,499       | 45,677  | 銀行                 |
| AZRIELI GROUP                | 65           | 65        | 1,300       | 39,598  | 不動産管理・開発           |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 7,617     | 7,606       | 21,038  | 640,821            |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 8         | 8           | —       | < 0.1% >           |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 1,528,975 | 1,720,128   | —       | 532,708,715        |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 1,248     | 1,252       | —       | < 95.8% >          |

\* 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により邦貨換算したものです。

\* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

| 銘柄                                   | 期首(前期末) |         | 当 期 末  |           |     |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
|                                      | 口 数     | 口 数     | 評 価 額  |           | 比 率 |
|                                      |         |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |     |
| (アメリカ)                               | 口       | 口       | 千米ドル   | 千円        | %   |
| AGNC INVESTMENT CORP                 | 71,000  | 80,000  | 934    | 101,690   | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT         | 14,400  | 17,900  | 2,589  | 281,786   | 0.1 |
| AMERICAN TOWER CORP                  | 60,200  | 69,400  | 16,002 | 1,741,525 | 0.3 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT            | 196,000 | 214,000 | 1,213  | 132,052   | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC            | 19,200  | 21,900  | 3,330  | 362,511   | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES                    | 20,700  | 24,700  | 2,296  | 249,885   | 0.0 |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | 15,000  | —       | —      | —         | —   |
| CAMDEN PROPERTY TRUST                | 13,100  | 14,500  | 1,208  | 131,513   | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTL CORP               | 56,800  | 64,500  | 9,549  | 1,039,312 | 0.2 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC             | 27,800  | 40,700  | 5,690  | 619,271   | 0.1 |
| DUKE REALTY CORP                     | 47,800  | 56,600  | 1,870  | 203,580   | 0.0 |
| EQUINIX INC                          | 10,930  | 13,250  | 8,544  | 929,900   | 0.2 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES          | —       | 26,500  | 1,499  | 163,234   | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL                   | 51,300  | 57,700  | 3,610  | 392,970   | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC             | 9,030   | 10,070  | 2,270  | 247,140   | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC              | 17,900  | 20,700  | 2,002  | 217,956   | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST            | 9,800   | 11,100  | 832    | 90,600    | 0.0 |
| HCP INC                              | 66,100  | —       | —      | —         | —   |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC            | —       | 75,700  | 1,843  | 200,605   | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC            | 100,000 | 109,000 | 1,244  | 135,469   | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC                 | 45,000  | 85,000  | 1,801  | 196,019   | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC                    | 38,300  | 43,100  | 1,071  | 116,560   | 0.0 |
| KIMCO REALTY CORP                    | 58,000  | 65,000  | 656    | 71,446    | 0.0 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST               | 19,800  | —       | —      | —         | —   |
| MACERICH CO /THE                     | 14,200  | —       | —      | —         | —   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC         | —       | 83,000  | 1,459  | 158,888   | 0.0 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM           | 15,000  | 17,600  | 1,885  | 205,197   | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC       | 22,000  | 27,900  | 919    | 100,017   | 0.0 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS           | —       | 32,200  | 856    | 93,180    | 0.0 |
| PROLOGIS INC                         | 86,300  | 114,500 | 9,489  | 1,032,770 | 0.2 |
| PUBLIC STORAGE                       | 21,500  | 24,500  | 4,939  | 537,613   | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP                   | 39,300  | 49,900  | 2,651  | 288,528   | 0.1 |
| REGENCY CENTERS CORP                 | 21,000  | 26,200  | 1,046  | 113,911   | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP              | 15,200  | 17,770  | 4,951  | 538,903   | 0.1 |
| SL GREEN REALTY CORP                 | 12,500  | 12,500  | 576    | 62,686    | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC             | 42,300  | 47,900  | 2,695  | 293,333   | 0.1 |
| SUN COMMUNITIES INC                  | —       | 14,300  | 1,749  | 190,362   | 0.0 |
| UDR INC                              | 36,700  | 46,300  | 1,746  | 190,064   | 0.0 |
| VENTAS INC                           | 49,200  | 56,800  | 1,635  | 177,966   | 0.0 |
| VEREIT INC                           | 125,000 | 160,000 | 796    | 86,715    | 0.0 |
| VICI PROPERTIES INC                  | —       | 68,000  | 1,090  | 118,703   | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST                 | 24,200  | 27,000  | 1,015  | 110,484   | 0.0 |
| WP CAREY INC                         | 21,500  | 27,400  | 1,625  | 176,858   | 0.0 |
| WELLTOWER INC                        | 51,700  | 63,100  | 2,977  | 323,993   | 0.1 |

| 銘柄                                   | 柄            | 期首(前期末)   |           | 当 期 末     |            |     |
|--------------------------------------|--------------|-----------|-----------|-----------|------------|-----|
|                                      |              | 口 数       | 口 数       | 評 価 額     |            | 比 率 |
|                                      |              |           |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額     |     |
| (アメリカ)                               |              | 口         | 口         | 千米ドル      | 千円         | %   |
| WEYERHAEUSER CO                      |              | 100,500   | 115,000   | 1,949     | 212,136    | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額    | 1,666,260 | 2,153,190 | 116,120   | 12,637,351 |     |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 39        | 41        | —         | < 2.3% >   |     |
| (カナダ)                                |              |           |           | 千カナダドル    |            |     |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA         |              | —         | 11,500    | 481       | 36,909     | 0.0 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT |              | —         | 16,000    | 216       | 16,570     | 0.0 |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS         |              | 20,000    | 20,000    | 171       | 13,113     | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR          |              | 22,000    | 22,000    | 357       | 27,350     | 0.0 |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV         |              | 11,000    | 11,000    | 204       | 15,647     | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額    | 53,000    | 80,500    | 1,430     | 109,591    |     |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 3         | 5         | —         | < 0.0% >   |     |
| (イギリス)                               |              |           |           | 千英ポンド     |            |     |
| BRITISH LAND                         |              | 128,000   | 128,000   | 416       | 55,495     | 0.0 |
| HAMMERSON PLC                        |              | 108,000   | —         | —         | —          | —   |
| SEGRO PLC                            |              | 145,000   | 176,000   | 1,319     | 175,935    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC            |              | 99,000    | 111,000   | 607       | 80,947     | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額    | 480,000   | 415,000   | 2,343     | 312,378    |     |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 4         | 3         | —         | < 0.1% >   |     |
| (ユーロ…フランス)                           |              |           |           | 千ユーロ      |            |     |
| ICADE                                |              | 5,100     | 5,200     | 378       | 45,256     | 0.0 |
| KLEPIERRE                            |              | 28,000    | 32,300    | 590       | 70,587     | 0.0 |
| GECINA SA                            |              | 6,400     | 7,100     | 864       | 103,299    | 0.0 |
| COVIVIO                              |              | 6,600     | 6,600     | 346       | 41,384     | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD            |              | 19,100    | 21,400    | 1,049     | 125,513    | 0.0 |
| ユ ー ロ 計                              | 口 数 ・ 金 額    | 65,200    | 72,600    | 3,229     | 386,042    |     |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 5         | 5         | —         | < 0.1% >   |     |
| (香港)                                 |              |           |           | 千香港ドル     |            |     |
| LINK REIT                            |              | 288,000   | 330,000   | 21,285    | 298,841    | 0.1 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS          |              | 370,000   | 370,000   | 2,797     | 39,272     | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額    | 658,000   | 700,000   | 24,082    | 338,114    |     |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 2         | 2         | —         | < 0.1% >   |     |
| (シンガポール)                             |              |           |           | 千シンガポールドル |            |     |
| CAPITALAND MALL TRUST                |              | 380,000   | 390,000   | 682       | 52,122     | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT         |              | 380,000   | 440,800   | 1,194     | 91,229     | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST          |              | 369,972   | 439,972   | 655       | 50,064     | 0.0 |
| SUNTEC REIT                          |              | 300,000   | 300,000   | 372       | 28,409     | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST           |              | —         | 370,000   | 673       | 51,427     | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額    | 1,429,972 | 1,940,772 | 3,578     | 273,253    |     |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 4         | 5         | —         | < 0.0% >   |     |
| (オーストラリア)                            |              |           |           | 千豪ドル      |            |     |
| MIRVAC GROUP                         |              | 490,000   | 660,000   | 1,320     | 87,238     | 0.0 |
| GPT GROUP                            |              | 256,000   | 285,000   | 1,014     | 67,054     | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP                      |              | 77,000    | 88,000    | 902       | 59,671     | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP                |              | 348,000   | 348,000   | 803       | 53,128     | 0.0 |
| DEXUS                                |              | 140,000   | 171,000   | 1,539     | 101,712    | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                        |              | 227,000   | 254,000   | 3,030     | 200,267    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                        |              | 723,000   | 870,000   | 1,283     | 84,809     | 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       |          |
| (オーストラリア)<br>VICINITY CENTRES | 口<br>480,000           | 口<br>470,000 | 千豪ドル<br>458 | 千円<br>30,285 | %<br>0.0 |
| 小 計                           | 口 数 ・ 金 額<br>2,741,000 | 3,146,000    | 10,352      | 684,168      |          |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                 | 8                      | 8            | —           | <0.1%>       |          |
| 合 計                           | 口 数 ・ 金 額<br>7,093,432 | 8,508,062    | —           | 14,740,901   |          |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                 | 65                     | 69           | —           | <2.7%>       |          |

\*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により邦貨換算したものです。

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 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 国   | 株式先物取引 | CAN60    | 百万円<br>279 | 百万円<br>— |
|       |        | EURO50   | 905        | —        |
|       |        | FT100    | 436        | —        |
|       |        | SPI200   | 180        | —        |
|       |        | SPEMINI  | 5,996      | —        |
|       |        | SWISSMKT | 314        | —        |

\*単位未満は切り捨て。

\*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により邦貨換算したものです。

### ○投資信託財産の構成

(2020年3月31日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>532,708,715 | %<br>94.0 |
| 投資証券         | 14,740,901        | 2.6       |
| コール・ローン等、その他 | 19,044,821        | 3.4       |
| 投資信託財産総額     | 566,494,437       | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産(549,961,136千円)の投資信託財産総額(566,494,437千円)に対する比率は97.1%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.83円、1カナダドル=76.60円、1英ポンド=133.32円、1スイスフラン=113.21円、1スウェーデンクローナ=10.81円、1ノルウェークローネ=10.26円、1デンマーククローネ=16.01円、1ユーロ=119.55円、1香港ドル=14.04円、1シンガポールドル=76.37円、1豪ドル=66.09円、1ニュージーランドドル=64.76円、1新シッケル=30.46円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月31日現在)

| 項目              | 当期末              |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 572,404,457,892  |
| コール・ローン等        | 15,096,264,525   |
| 株式(評価額)         | 532,708,715,674  |
| 投資証券(評価額)       | 14,740,901,142   |
| 未収入金            | 6,512,762,172    |
| 未収配当金           | 962,507,146      |
| 差入委託証拠金         | 2,383,307,233    |
| (B) 負債          | 16,380,641,803   |
| 未払金             | 16,130,112,047   |
| 未払解約金           | 245,599,738      |
| 未払利息            | 11,518           |
| その他未払費用         | 4,918,500        |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 556,023,816,089  |
| 元本              | 230,777,414,749  |
| 次期繰越損益金         | 325,246,401,340  |
| (D) 受益権総口数      | 230,777,414,749口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 24,094円          |

(注) 期首元本額は207,721,483,594円、期中追加設定元本額は56,924,689,531円、期中一部解約元本額は33,868,758,376円、1口当たり純資産額は2.4094円です。

## ○損益の状況 (2019年4月2日～2020年3月31日)

| 項目                 | 当期               |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | 12,940,662,190   |
| 受取配当金              | 12,855,664,954   |
| 受取利息               | 42,925,608       |
| その他収益金             | 45,462,550       |
| 支払利息               | △ 3,390,922      |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 80,856,550,657 |
| 売買益                | 31,778,609,458   |
| 売買損                | △112,635,160,115 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 563,715,596    |
| 取引益                | 2,176,335,441    |
| 取引損                | △ 2,740,051,037  |
| (D) 保管費用等          | △ 60,024,967     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 68,539,629,030 |
| (F) 前期繰越損益金        | 358,713,626,420  |
| (G) 追加信託差損益金       | 97,476,543,113   |
| (H) 解約差損益金         | △ 62,404,139,163 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 325,246,401,340  |
| 次期繰越損益金(I)         | 325,246,401,340  |

\*損益の状況の中で(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えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、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をいいます。

\*損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名   | 当期末            |
|---|----------------|
|   | 元本額            |
|   | 円              |
| 野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)       | 67,352,314,919 |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)                  | 36,321,368,128 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI               | 22,255,621,713 |
| 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用) | 16,200,200,467 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                            | 10,232,027,680 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                            | 8,902,069,455  |
| のむらップ・ファンド(普通型)                               | 8,834,948,702  |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)                            | 6,135,950,276  |
| のむらップ・ファンド(積極型)                               | 5,764,474,434  |
| 野村インデックスファンド・外国株式                             | 5,085,341,526  |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)                            | 4,660,174,843  |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)                            | 4,420,419,039  |
| 野村つみたて外国株投信                                   | 4,278,259,185  |
| 野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)           | 3,653,207,390  |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                            | 3,019,550,038  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)            | 2,961,246,485  |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)              | 2,177,660,268  |
| マイバランスDC50                                    | 2,046,408,931  |

| ファンド名  | 当期末           |
|--|---------------|
|  | 元本額           |
|  | 円             |
| マイ・ロード   | 1,600,015,897 |
| マイバランスDC70                                     | 1,584,081,235 |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)                   | 1,570,017,565 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式                         | 1,246,658,042 |
| ノムラFoFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)             | 1,240,519,467 |
| のむらップ・ファンド(保守型)                                | 1,222,162,509 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)               | 1,151,069,845 |
| マイバランスDC30                                     | 1,099,765,570 |
| 野村6資産均等バランス                                    | 643,512,929   |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)                           | 607,510,683   |
| 野村外国株式インデックスファンド                               | 518,274,940   |
| NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 485,371,313   |
| のむらップ・ファンド(やや積極型)                              | 440,681,091   |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)                          | 275,786,534   |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)               | 246,564,408   |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)                          | 228,702,850   |
| のむらップ・ファンド(やや保守型)                              | 223,325,959   |
| 野村DC運用戦略ファンド                                   | 216,326,337   |

| ファンド名                                | 当期末         |
|--------------------------------------|-------------|
|                                      | 元本額         |
|                                      | 円           |
| グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)    | 180,296,083 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)               | 174,633,368 |
| バランスセレクト70                           | 155,428,916 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)  | 153,679,384 |
| バランスセレクト50                           | 144,817,704 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス               | 129,365,827 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)               | 93,721,552  |
| 世界6資産分散ファンド                          | 67,538,180  |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)               | 62,582,474  |
| 野村資産設計ファンド2040                       | 60,883,618  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)   | 49,066,901  |
| バランスセレクト30                           | 45,606,729  |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)             | 44,016,998  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用)  | 41,225,030  |
| 野村資産設計ファンド2030                       | 37,195,280  |
| 野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド (適格機関投資家専用) | 30,720,896  |
| 野村資産設計ファンド2025                       | 30,275,301  |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)               | 30,055,352  |
| インデックス・ブレンド (タイプV)                   | 29,087,179  |
| 野村資産設計ファンド2035                       | 28,812,214  |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)               | 26,822,093  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース               | 23,250,293  |
| インデックス・ブレンド (タイプIII)                 | 22,713,083  |
| 野村資産設計ファンド2020                       | 18,389,209  |
| 野村外国株式インデックスファンド (適格機関投資家専用)         | 16,933,862  |
| 野村資産設計ファンド2015                       | 16,224,931  |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド)                  | 15,363,144  |

| ファンド名   | 当期末        |
|---|------------|
|   | 元本額        |
|   | 円          |
| ネクストコア  | 15,297,514 |
| 野村資産設計ファンド2050                                | 14,984,107 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)               | 14,057,350 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)                         | 12,569,368 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)                         | 11,389,463 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース                        | 10,685,299 |
| 野村資産設計ファンド2045                                | 9,067,287  |
| インデックス・ブレンド (タイプIV)                           | 7,480,531  |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型 (適格機関投資家専用)           | 6,606,701  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース                      | 5,768,243  |
| 野村資産設計ファンド2060                                | 4,928,471  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型              | 4,900,497  |
| インデックス・ブレンド (タイプII)                           | 3,672,056  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA (適格機関投資家専用)            | 3,286,325  |
| インデックス・ブレンド (タイプI)                            | 2,914,635  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2030              | 2,756,083  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型 (適格機関投資家専用)             | 2,662,077  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型              | 2,203,199  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2050              | 2,110,719  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2040              | 2,088,740  |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)                         | 1,982,969  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型              | 1,775,244  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用)             | 1,595,704  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型              | 1,124,486  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2060              | 667,236    |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信                                | 415,117    |
| 野村OF用・ターゲット・リターン・資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 129,074    |

## 〇お知らせ

該当事項はございません。

# 野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ マザーファンド

## 運用報告書

第4期（決算日2021年2月15日）

作成対象期間（2020年2月14日～2021年2月15日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。<br>外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。   |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。  |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○設定以来の運用実績

| 決算期                 | 基準価額   |       | 参考指数   |      | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>組入比率 | 純資産<br>総額  |
|---------------------|--------|-------|--------|------|------------|------------|--------------|------------|
|                     | 円      | 騰落率   | 100.00 | %    |            |            |              |            |
| (設定日)<br>2016年9月29日 | 10,000 | —     | 100.00 | —    | —          | —          | —            | 百万円<br>299 |
| 1期(2018年2月13日)      | 11,805 | 18.1  | 134.32 | 34.3 | 93.6       | —          | 4.7          | 442        |
| 2期(2019年2月13日)      | 12,966 | 9.8   | 137.56 | 2.4  | 85.5       | —          | 13.0         | 810        |
| 3期(2020年2月13日)      | 15,154 | 16.9  | 165.61 | 20.4 | 86.7       | —          | 12.4         | 1,071      |
| 4期(2021年2月15日)      | 14,695 | △ 3.0 | 189.76 | 14.6 | 95.2       | —          | 1.7          | 1,755      |

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*参考指数(=「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス除く日本(税引前配当込み、円換算ベース、為替ヘッジなし)」)は、MSCI ACWI ex Japanをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。設定時を100として指数化しております。  
\*MSCI ACWI ex Japanは、MSCIが開発した指数で、同指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利はMSCIに帰属します。また、MSCIは、同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。  
(出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

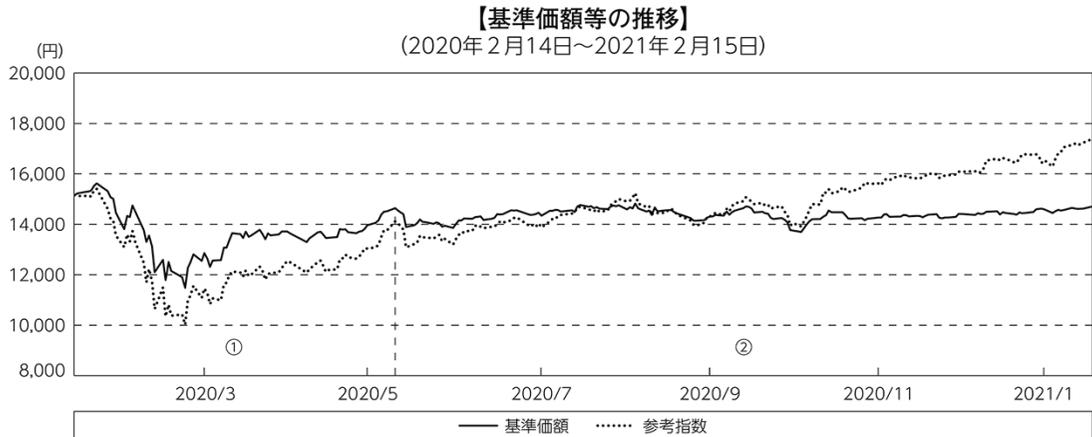
| 年月日                | 基準価額   |       | 参考指数   |       | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|--------------------|--------|-------|--------|-------|------------|------------|--------------|-----------|
|                    | 円      | 騰落率   | 100.00 | %     |            |            |              |           |
| (期首)<br>2020年2月13日 | 15,154 | —     | 165.61 | —     | 86.7       | —          | 12.4         | %         |
| 2月末                | 14,454 | △ 4.6 | 148.08 | △10.6 | 87.0       | —          | 11.5         |           |
| 3月末                | 12,855 | △15.2 | 125.13 | △24.4 | 87.1       | —          | 11.3         |           |
| 4月末                | 13,713 | △ 9.5 | 137.08 | △17.2 | 87.3       | —          | 10.3         |           |
| 5月末                | 13,960 | △ 7.9 | 142.51 | △14.0 | 91.1       | —          | 7.7          |           |
| 6月末                | 13,998 | △ 7.6 | 146.39 | △11.6 | 93.1       | —          | 5.7          |           |
| 7月末                | 14,345 | △ 5.3 | 151.68 | △ 8.4 | 94.1       | —          | 3.9          |           |
| 8月末                | 14,593 | △ 3.7 | 162.91 | △ 1.6 | 94.8       | —          | 2.5          |           |
| 9月末                | 14,307 | △ 5.6 | 156.49 | △ 5.5 | 95.8       | —          | 2.2          |           |
| 10月末               | 13,754 | △ 9.2 | 153.48 | △ 7.3 | 96.6       | —          | 2.7          |           |
| 11月末               | 14,268 | △ 5.8 | 170.76 | 3.1   | 95.1       | —          | 2.7          |           |
| 12月末               | 14,412 | △ 4.9 | 175.68 | 6.1   | 95.7       | —          | 2.7          |           |
| 2021年1月末           | 14,595 | △ 3.7 | 180.84 | 9.2   | 95.3       | —          | 1.7          |           |
| (期末)<br>2021年2月15日 | 14,695 | △ 3.0 | 189.76 | 14.6  | 95.2       | —          | 1.7          |           |

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) 参考指数は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス除く日本（税引前配当込み、円換算ベース、為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

#### ①の局面（期首～2020年6月上旬）

(下落) 新型コロナウイルスの世界的な感染拡大が警戒されリスク回避の動きが強まったこと  
(上昇) 各国中央銀行が金融市場への大規模な下支え策を発表したことで先行きに対する過度な不安が和らいだこと

#### ②の局面（2020年6月中旬～期末）

(横ばい) ファンドで多く保有する景気動向に左右されにくい生活必需品や公益事業、ヘルスケアなどが小幅上昇にとどまったことや、2020年8月中旬以降の金価格下落トレンドによりファンドで多く保有する金鉱山銘柄の株価推移が軟調となったこと

### ○当ファンドのポートフォリオ

#### ・株式組入比率

運用の基本方針に基づき、期を通じて高位を維持し、期末は97.0%（投資信託証券含む）としました。

#### ・期中の主な動き

財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行ない、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指しました。ポートフォリオの最適化にあたっては、国別配分、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案しました。

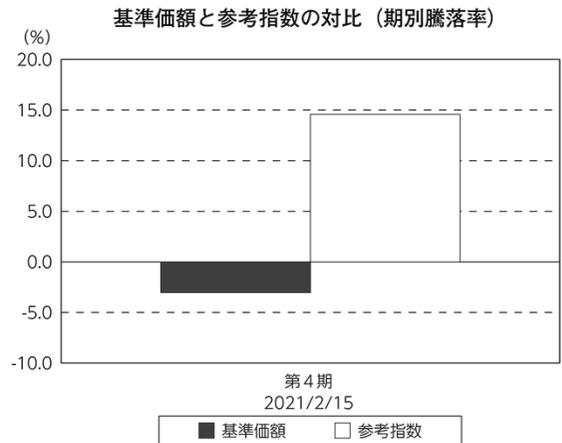
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としているMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス除く日本（税引前配当込み、円換算ベース、為替ヘッジなし）※の騰落率が+14.6%になったのに対して、基準価額は-3.0%となりました。

\* 「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス除く日本（税引前配当込み、円換算ベース、為替ヘッジなし）」は、MSCI ACWI ex Japan をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。



(注) 参考指数は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス除く日本（税引前配当込み、円換算ベース、為替ヘッジなし）です。

## (主なマイナス要因)

投資比率の高い「低ベータ株（市場連動性の低い株式）」の騰落率が参考指数と比べて低かったことや、投資比率の低い「情報技術セクター」の騰落率が参考指数と比べて高かったことなどがマイナスに影響しました。

## ◎今後の運用方針

引き続き、株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行ない、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。ポートフォリオの最適化にあたっては、国別配分、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年2月14日～2021年2月15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>( 投 資 信 託 証 券 ) | 円<br>13<br>(12)<br>( 1 ) | %<br>0.092<br>(0.084)<br>(0.007) | (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                                   |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税<br>( 株 式 )<br>( 投 資 信 託 証 券 ) | 8<br>( 8 )<br>( 0 )      | 0.059<br>(0.056)<br>(0.003)      | (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                                    |
| (c) そ の 他 費 用<br>( 保 管 費 用 )<br>( そ の 他 )       | 27<br>(26)<br>( 1 )      | 0.189<br>(0.184)<br>(0.005)      | (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>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計   | 48                       | 0.340                            |  |
| 期中の平均基準価額は、14,104円です。                           |                          |                                  |  |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2020年2月14日～2021年2月15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>848<br>( 30) | 千米ドル<br>7,382<br>( -)     | 百株<br>663               | 千米ドル<br>5,330       |                   |
|        | カナダ    | 452                | 千カナダドル<br>1,373           | 624                     | 千カナダドル<br>1,641     |                   |
|        | イギリス   | 240                | 千英ポンド<br>293              | 447                     | 千英ポンド<br>221        |                   |
|        | スイス    | 64<br>( 3)         | 千スイスフラン<br>1,461<br>(△ 2) | 50                      | 千スイスフラン<br>919      |                   |
|        | スウェーデン | 37                 | 千スウェーデンクローナ<br>1,637      | 9                       | 千スウェーデンクローナ<br>398  |                   |
|        | ノルウェー  | 80                 | 千ノルウェークローネ<br>1,038       | 71                      | 千ノルウェークローネ<br>1,028 |                   |
|        | デンマーク  | 105                | 千デンマーククローネ<br>5,108       | 65                      | 千デンマーククローネ<br>1,937 |                   |
|        | トルコ    | 55                 | 千トルコリラ<br>310             | -                       | 千トルコリラ<br>-         |                   |
|        | ユーロ    |                    | 千ユーロ                      |                         | 千ユーロ                |                   |
|        |        | ドイツ                | 689<br>( -)               | 844<br>(△ 26)           | 530                 | 948               |
|        |        | イタリア               | 485                       | 649                     | 247                 | 275               |
|        |        | フランス               | 134                       | 689                     | 176                 | 373               |
|        |        | オランダ               | 643                       | 439                     | 322                 | 211               |
|        |        | スペイン               | 215                       | 254                     | 203                 | 221               |
|        |        | ベルギー               | 77                        | 309                     | 98                  | 295               |
|        |        | フィンランド             | 68<br>( 23)               | 318<br>( -)             | 79                  | 241               |
|        |        | アイルランド             | 0.99                      | 10                      | -                   | -                 |
|        |        | ポルトガル              | 68                        | 101                     | 6                   | 9                 |
|        |        | 香港                 | 9,804<br>( 114)           | 千香港ドル<br>14,370<br>( -) | 3,118               | 千香港ドル<br>5,288    |
|        |        | シンガポール             | 581                       | 千シンガポールドル<br>347        | 627                 | 千シンガポールドル<br>271  |
|        |        | マレーシア              | 4,802                     | 千リンギ<br>3,744           | 502                 | 千リンギ<br>490       |
|        |        | タイ                 | 665                       | 千バーツ<br>5,832           | 598                 | 千バーツ<br>4,740     |
|        |        | フィリピン              | 10                        | 千フィリピンペソ<br>2,046       | 10                  | 千フィリピンペソ<br>2,051 |
|        |        | インドネシア             | 712                       | 千ルピア<br>334,390         | 1,655               | 千ルピア<br>660,749   |
|        |        | 韓国                 | 5                         | 千ウォン<br>151,844         | 0.38                | 千ウォン<br>61,667    |

|        |          | 買 付                   |                            | 売 付       |                    |
|--------|----------|-----------------------|----------------------------|-----------|--------------------|
|        |          | 株 数                   | 金 額                        | 株 数       | 金 額                |
| 外<br>国 | 台湾       | 百株<br>4,550<br>( 102) | 千新台幣ドル<br>17,393<br>(△ 10) | 百株<br>200 | 千新台幣ドル<br>486      |
|        | オーストラリア  | 369                   | 千豪ドル<br>194                | 638       | 千豪ドル<br>423        |
|        | ニュージーランド | 80                    | 千ニュージーランドドル<br>269         | 80        | 千ニュージーランドドル<br>287 |
|        | イスラエル    | 230<br>( 3)           | 千新シエケル<br>687<br>( ー)      | 354       | 千新シエケル<br>906      |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 投資信託証券

| 銘 柄                         |                                | 買 付   |         | 売 付    |      |
|-----------------------------|--------------------------------|-------|---------|--------|------|
|                             |                                | 口 数   | 金 額     | 口 数    | 金 額  |
| 外<br>国                      | アメリカ                           | 口     | 千米ドル    | 口      | 千米ドル |
|                             | AGNC INVESTMENT CORP           | 8,500 | 116     | 13,700 | 177  |
|                             | AMERICAN TOWER CORP            | 400   | 95      | 400    | 95   |
|                             | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT      | 9,700 | 76      | 19,400 | 127  |
|                             | AVALONBAY COMMUNITIES INC      | 400   | 68      | 800    | 122  |
|                             | CAMDEN PROPERTY TRUST          | 700   | 65      | 1,300  | 115  |
|                             | CROWN CASTLE INTL CORP         | 400   | 64      | 1,100  | 175  |
|                             | DUKE REALTY CORP               | —     | —       | 600    | 18   |
|                             | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES    | 1,300 | 79      | 2,300  | 146  |
|                             | ESSEX PROPERTY TRUST INC       | 200   | 50      | 300    | 66   |
|                             | EXTRA SPACE STORAGE INC        | 500   | 47      | 900    | 95   |
|                             | HEALTHPEAK PROPERTIES INC      | 800   | 20      | 1,200  | 31   |
|                             | INVITATION HOMES INC           | 2,100 | 50      | 3,900  | 108  |
|                             | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 1,500 | 58      | 2,500  | 77   |
|                             | PUBLIC STORAGE                 | 600   | 125     | 500    | 108  |
|                             | REALTY INCOME CORP             | 1,600 | 95      | 2,800  | 168  |
|                             | UDR INC                        | 1,400 | 56      | 2,500  | 93   |
| VENTAS INC                  | 1,000                          | 23    | 1,300   | 35     |      |
| WP CAREY INC                | 1,800                          | 117   | 2,800   | 173    |      |
| 小 計                         | 32,900                         | 1,215 | 58,300  | 1,937  |      |
| 香港                          |                                | 千香港ドル |         | 千香港ドル  |      |
| LINK REIT                   | 14,500                         | 962   | 13,700  | 892    |      |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 190,000                        | 1,500 | 110,500 | 841    |      |
| 小 計                         | 204,500                        | 2,463 | 124,200 | 1,734  |      |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○株式売買比率

(2020年2月14日～2021年2月15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       | 3,554,484千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 1,788,831千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.98        |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年2月14日～2021年2月15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2月15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     |                |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | —       | 15  | 155   | 16,368 | 娯楽             |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 3       | 11  | 53    | 5,583  | 電力             |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 8       | 6   | 47    | 4,958  | 電力             |
| AVANGRID INC                 | 8       | —   | —     | —      | 電力             |
| BECTON, DICKINSON            | —       | 1   | 25    | 2,694  | ヘルスケア機器・用品     |
| BROWN & BROWN INC            | 5       | —   | —     | —      | 保険             |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 2       | —   | —     | —      | 資本市場           |
| CME GROUP INC                | 5       | —   | —     | —      | 資本市場           |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 9       | 21  | 174   | 18,309 | 家庭用品           |
| CITRIX SYSTEMS INC           | —       | 12  | 165   | 17,367 | ソフトウェア         |
| CLOROX CO                    | 4       | 9   | 167   | 17,594 | 家庭用品           |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | —       | 12  | 103   | 10,842 | ソフトウェア         |
| COCA COLA CO                 | 24      | —   | —     | —      | 飲料             |
| COLGATE PALMOLIVE CO.        | 12      | 22  | 172   | 18,138 | 家庭用品           |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 2       | 6   | 42    | 4,481  | 総合公益事業         |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | —       | 6   | 211   | 22,248 | 食品・生活必需品小売り    |
| DTE ENERGY COMPANY           | 7       | —   | —     | —      | 総合公益事業         |
| DOLLAR GENERAL CORP          | —       | 4   | 79    | 8,350  | 複合小売り          |
| DOMINION ENERGY INC          | 14      | 12  | 86    | 9,065  | 総合公益事業         |
| DUKE ENERGY CORP             | 11      | —   | —     | —      | 電力             |
| ELECTRONIC ARTS              | —       | 12  | 177   | 18,636 | 娯楽             |
| GENERAL MILLS                | 10      | 23  | 131   | 13,810 | 食品             |
| GILEAD SCIENCES INC          | —       | 26  | 173   | 18,281 | バイオテクノロジー      |
| HERSHEY CO/THE               | 7       | 9   | 136   | 14,321 | 食品             |
| HORMEL FOODS CORP            | 22      | 37  | 178   | 18,762 | 食品             |
| JOHNSON & JOHNSON            | 9       | 17  | 283   | 29,768 | 医薬品            |
| KELLOGG CO                   | 14      | 25  | 143   | 15,079 | 食品             |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 8       | 13  | 171   | 18,056 | 家庭用品           |
| KROGER CO                    | 18      | 57  | 193   | 20,342 | 食品・生活必需品小売り    |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 11      | —   | —     | —      | 食品             |
| ELI LILLY & CO.              | —       | 10  | 207   | 21,790 | 医薬品            |
| MCCORMICK & CO INC.          | 3       | 10  | 89    | 9,424  | 食品             |
| MCDONALD'S CORP              | 6       | —   | —     | —      | ホテル・レストラン・レジャー |
| MERCK & CO INC               | 15      | 29  | 217   | 22,863 | 医薬品            |
| MODERNA INC                  | —       | 6   | 110   | 11,588 | バイオテクノロジー      |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | —       | 8   | 43    | 4,558  | コングロマリット       |
| NEWMONT CORP                 | 23      | 26  | 153   | 16,109 | 金属・鉱業          |
| NEXTERA ENERGY INC           | 5       | 24  | 199   | 20,972 | 電力             |
| PEPSICO INC                  | 10      | 16  | 214   | 22,515 | 飲料             |
| PINDUODUO INC ADR            | —       | 2   | 39    | 4,133  | インターネット販売・通信販売 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP   | 4       | —   | —     | —      | 電力             |
| PROCTER & GAMBLE CO          | 13      | 20  | 255   | 26,830 | 家庭用品           |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | —       | 3   | 145   | 15,314 | バイオテクノロジー      |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A   | 11      | —   | —     | —      | 商業サービス・用品      |
| SEAGEN INC                   | —       | 2   | 33    | 3,486  | バイオテクノロジー      |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW        | 3       | 6   | 69    | 7,259  | 食品             |
| SOUTHERN CO.                 | 17      | —   | —     | —      | 電力             |
| SYSCO CORP                   | 12      | —   | —     | —      | 食品・生活必需品小売り    |

| 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     |                |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | —            | 4    | 79      | 8,403  | 娯楽             |  |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR      | —            | 9    | 23      | 2,493  | 娯楽             |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS            | 24           | 41   | 222     | 23,359 | 各種電気通信サービス     |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS            | —            | 8    | 171     | 17,994 | バイオテクノロジー      |  |
| WEC ENERGY GROUP INC              | 10           | 19   | 157     | 16,587 | 総合公益事業         |  |
| WALMART INC                       | 11           | 16   | 231     | 24,298 | 食品・生活必需品小売り    |  |
| WASTE MANAGEMENT INC              | 1            | —    | —       | —      | 商業サービス・用品      |  |
| XCEL ENERGY INC                   | 4            | 8    | 49      | 5,175  | 電力             |  |
| YUM BRANDS INC                    | 10           | —    | —       | —      | ホテル・レストラン・レジャー |  |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC            | —            | 17   | 65      | 6,876  | 航空貨物・物流サービス    |  |
| ZSCALER INC                       | —            | 4    | 90      | 9,523  | ソフトウェア         |  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A       | —            | 2    | 86      | 9,105  | ソフトウェア         |  |
| AMDOCS LTD                        | 2            | —    | —       | —      | 情報技術サービス       |  |
| BUNGE LIMITED                     | 9            | —    | —       | —      | 食品             |  |
| CREDICORP LTD                     | 5            | —    | —       | —      | 銀行             |  |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS       | 13           | —    | —       | —      | 飲料             |  |
| EVEREST RE GROUP LTD              | 3            | —    | —       | —      | 保険             |  |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD          | 4            | —    | —       | —      | 保険             |  |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額    | 431  | 646     | 6,028  | 633,728        |  |
|                                   | 銘柄 数 < 比 率 > | 46   | 45      | —      | <36.1%>        |  |
| (カナダ)                             |              |      | 千カナダドル  |        |                |  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD            | 16           | 19   | 160     | 13,331 | 金属・鉱業          |  |
| BCE INC                           | 19           | 26   | 144     | 11,951 | 各種電気通信サービス     |  |
| BARRICK GOLD                      | 59           | 62   | 174     | 14,442 | 金属・鉱業          |  |
| EMPIRE CO LTD A                   | 11           | —    | —       | —      | 食品・生活必需品小売り    |  |
| FRANCO-NEVADA CORP                | 9            | 13   | 199     | 16,559 | 金属・鉱業          |  |
| KINROSS GOLD CORP                 | 191          | —    | —       | —      | 金属・鉱業          |  |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD            | 14           | —    | —       | —      | 金属・鉱業          |  |
| LOBLAW COMPANIES                  | 9            | 16   | 100     | 8,294  | 食品・生活必需品小売り    |  |
| METRO INC                         | 23           | 37   | 202     | 16,784 | 食品・生活必需品小売り    |  |
| WASTE CONNECTIONS INC             | 2            | 5    | 63      | 5,227  | 商業サービス・用品      |  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP      | 26           | 29   | 147     | 12,259 | 金属・鉱業          |  |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額    | 379  | 207     | 1,193  | 98,850         |  |
|                                   | 銘柄 数 < 比 率 > | 11   | 8       | —      | <5.6%>         |  |
| (イギリス)                            |              |      | 千英ポンド   |        |                |  |
| MORRISON SUPERMARKETS             | 263          | 159  | 27      | 3,969  | 食品・生活必需品小売り    |  |
| ASTRAZENECA PLC                   | —            | 1    | 14      | 2,146  | 医薬品            |  |
| UNILEVER PLC                      | 9            | 18   | 71      | 10,427 | パーソナル用品        |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 6            | 19   | 119     | 17,484 | 家庭用品           |  |
| COMPASS GROUP PLC                 | 23           | —    | —       | —      | ホテル・レストラン・レジャー |  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       | 102          | —    | —       | —      | 保険             |  |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額    | 404  | 198     | 233    | 34,027         |  |
|                                   | 銘柄 数 < 比 率 > | 5    | 4       | —      | <1.9%>         |  |
| (スイス)                             |              |      | 千スイスフラン |        |                |  |
| BARRY CALLEBAUT AG                | 0.29         | 0.46 | 93      | 10,961 | 食品             |  |
| SWISSCOM AG-REG                   | 1            | 3    | 153     | 18,131 | 各種電気通信サービス     |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC        | 0.1          | 0.17 | 139     | 16,438 | 食品             |  |
| NOVARTIS AG-REG                   | —            | 7    | 63      | 7,489  | 医薬品            |  |
| ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)      | —            | 6    | 214     | 25,320 | 医薬品            |  |
| NESTLE SA-REG                     | 14           | 23   | 236     | 27,822 | 食品             |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG             | 1            | —    | —       | —      | ヘルスケア機器・用品     |  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG      | 0.19         | —    | —       | —      | 銀行             |  |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG         | —            | 1    | 109     | 12,868 | 化学             |  |
| PSP SWISS PROPERTY AG-REG         | 6            | —    | —       | —      | 不動産管理・開発       |  |

| 銘柄                                | 株数               | 当 期 末    |             | 業 種 等                |                |
|-----------------------------------|------------------|----------|-------------|----------------------|----------------|
|                                   |                  | 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                   |                |
| SWISS PRIME SITE-REG              | 5                | —        | —           | 不動産管理・開発             |                |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG      | —                | 3        | 33          | 銀行                   |                |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 29<br>8  | 46<br>8     | 1,043<br>—<br><7.0%> | 123,014        |
| (スウェーデン)                          |                  |          | 千スウェーデンクローナ |                      |                |
| ICA GRUPPEN AB                    | 6                | 34       | 1,413       | 17,893               | 食品・生活必需品小売り    |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 6<br>1   | 34<br>1     | 1,413<br>—<br><1.0%> | 17,893         |
| (ノルウェー)                           |                  |          | 千ノルウェークローネ  |                      |                |
| TELENOR ASA                       | 24               | 15       | 219         | 2,732                | 各種電気通信サービス     |
| ORKLA ASA                         | 32               | 49       | 402         | 5,010                | 食品             |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 56<br>2  | 65<br>2     | 622<br>—<br><0.4%>   | 7,743          |
| (デンマーク)                           |                  |          | 千デンマーククローネ  |                      |                |
| GENMAB A/S                        | —                | 0.55     | 137         | 2,362                | バイオテクノロジー      |
| H LUNDBECK A/S                    | 4                | —        | —           | —                    | 医薬品            |
| CHR HANSEN HOLDING A/S            | —                | 13       | 778         | 13,333               | 化学             |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES            | —                | 12       | 522         | 8,941                | 化学             |
| COLOPLAST-B                       | 3                | 12       | 1,293       | 22,160               | ヘルスケア機器・用品     |
| NOVO NORDISK A/S-B                | —                | 26       | 1,223       | 20,952               | 医薬品            |
| TRYG A/S                          | 17               | —        | —           | —                    | 保険             |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 26<br>3  | 66<br>5     | 3,955<br>—<br><3.9%> | 67,751         |
| (トルコ)                             |                  |          | 千トルコリラ      |                      |                |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS         | —                | 55       | 379         | 5,680                | 食品・生活必需品小売り    |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | —<br>—   | 55<br>1     | 379<br>—<br><0.3%>   | 5,680          |
| (ユーロ…ドイツ)                         |                  |          | 千ユーロ        |                      |                |
| FIELMANN AG                       | 1                | —        | —           | —                    | 専門小売り          |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 1                | 2        | 21          | 2,801                | 家庭用品           |
| BEIERSDORF AG                     | 7                | 15       | 140         | 17,926               | パーソナル用品        |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG              | 62               | —        | —           | —                    | 各種電気通信サービス     |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                | 24               | 31       | 128         | 16,362               | 不動産管理・開発       |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 278              | 498      | 114         | 14,536               | 各種電気通信サービス     |
| LEG IMMOBILIEN AG                 | 2                | —        | —           | —                    | 不動産管理・開発       |
| VONOVIA SE                        | 17               | —        | —           | —                    | 不動産管理・開発       |
| HELLOFRESH SE                     | —                | 8        | 67          | 8,631                | インターネット販売・通信販売 |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 397<br>8 | 556<br>5    | 472<br>—<br><3.4%>   | 60,257         |
| (ユーロ…イタリア)                        |                  |          |             |                      |                |
| ASSICURAZIONI GENERALI            | 40               | —        | —           | —                    | 保険             |
| SNAM SPA                          | 107              | 245      | 109         | 13,962               | ガス             |
| RECORDATI SPA                     | —                | 30       | 135         | 17,330               | 医薬品            |
| DIASORIN SPA                      | —                | 8        | 149         | 19,111               | ヘルスケア機器・用品     |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL      | —                | 101      | 94          | 12,025               | 各種電気通信サービス     |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 147<br>2 | 385<br>4    | 489<br>—<br><3.6%>   | 62,429         |
| (ユーロ…フランス)                        |                  |          |             |                      |                |
| LOREAL-ORD                        | —                | 5        | 168         | 21,417               | パーソナル用品        |
| ORANGE SA                         | 65               | —        | —           | —                    | 各種電気通信サービス     |
| SOCIETE BIC SA                    | 8                | —        | —           | —                    | 商業サービス・用品      |
| SANOFI                            | —                | 16       | 129         | 16,544               | 医薬品            |

| 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…フランス)                    |              | 百株    | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |             |
| BIOMERIEUX                    |              | —     | 11    | 138    | 17,607    | ヘルスケア機器・用品  |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額    | 74    | 32    | 436    | 55,569    |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 2     | 3     | —      | < 3.2% >  |             |
| (ユーロ…オランダ)                    |              |       |       |        |           |             |
| VOPAK                         |              | —     | 31    | 136    | 17,401    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| KONINKLIJKE KPN NV            |              | 186   | 457   | 133    | 17,065    | 各種電気通信サービス  |
| HEINEKEN NV                   |              | 2     | —     | —      | —         | 飲料          |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV |              | 38    | 59    | 139    | 17,772    | 食品・生活必需品小売り |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額    | 227   | 547   | 409    | 52,239    |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 3     | 3     | —      | < 3.0% >  |             |
| (ユーロ…スペイン)                    |              |       |       |        |           |             |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA  |              | 15    | 28    | 42     | 5,364     | 電力          |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額    | 15    | 28    | 42     | 5,364     |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 1     | 1     | —      | < 0.3% >  |             |
| (ユーロ…ベルギー)                    |              |       |       |        |           |             |
| UCB SA                        |              | 9     | 14    | 123    | 15,695    | 医薬品         |
| COLRUYT SA                    |              | 18    | 27    | 138    | 17,702    | 食品・生活必需品小売り |
| PROXIMUS                      |              | 35    | —     | —      | —         | 各種電気通信サービス  |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額    | 63    | 41    | 262    | 33,398    |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 3     | 2     | —      | < 1.9% >  |             |
| (ユーロ…フィンランド)                  |              |       |       |        |           |             |
| KESKO OYJ-B SHS               |              | 2     | —     | —      | —         | 食品・生活必需品小売り |
| SAMPO OYJ-A SHS               |              | 13    | —     | —      | —         | 保険          |
| ELISA OYJ                     |              | 16    | 30    | 151    | 19,243    | 各種電気通信サービス  |
| KONE OYJ                      |              | —     | 9     | 66     | 8,467     | 機械          |
| ORION OYJ                     |              | —     | 5     | 19     | 2,423     | 医薬品         |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額    | 32    | 45    | 236    | 30,133    |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 3     | 3     | —      | < 1.7% >  |             |
| (ユーロ…アイルランド)                  |              |       |       |        |           |             |
| KERRY GROUP PLC-A             |              | 1     | 2     | 24     | 3,122     | 食品          |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額    | 1     | 2     | 24     | 3,122     |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 1     | 1     | —      | < 0.2% >  |             |
| (ユーロ…ポルトガル)                   |              |       |       |        |           |             |
| JERONIMO MARTINS              |              | 12    | 73    | 93     | 11,900    | 食品・生活必需品小売り |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額    | 12    | 73    | 93     | 11,900    |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 1     | 1     | —      | < 0.7% >  |             |
| ユ ー ロ 計                       | 株 数 ・ 金 額    | 971   | 1,713 | 2,467  | 314,416   |             |
|                               | 銘柄 数 < 比 率 > | 24    | 23    | —      | < 17.9% > |             |
| (香港)                          |              |       |       | 千香港ドル  |           |             |
| CHINA MOBILE LTD              |              | 45    | —     | —      | —         | 無線通信サービス    |
| CLP HLDGS                     |              | 65    | 195   | 1,407  | 19,091    | 電力          |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD      |              | —     | 80    | 432    | 5,868     | パーソナル用品     |
| MTR CORP                      |              | 45    | 310   | 1,391  | 18,874    | 陸運・鉄道       |
| HANG SENG BANK                |              | 26    | 44    | 643    | 8,722     | 銀行          |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD     |              | 100   | 190   | 785    | 10,653    | 電力          |
| HONG KONG & CHINA GAS         |              | 282   | 1,182 | 1,298  | 17,608    | ガス          |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT  |              | 20    | 60    | 243    | 3,295     | ガス          |
| PCCW LTD                      |              | 100   | 490   | 224    | 3,043     | 各種電気通信サービス  |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO  |              | —     | 180   | 270    | 3,661     | 食品          |
| GUANGDONG INVESTMENT          |              | 100   | —     | —      | —         | 水道          |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H     |              | —     | 1,020 | 635    | 8,616     | 銀行          |
| IND & COMM BK OF CHINA-H      |              | —     | 970   | 485    | 6,576     | 銀行          |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD      |              | —     | 380   | 269    | 3,658     | 食品・生活必需品小売り |
| HKT TRUST AND HKT LTD         |              | 330   | 790   | 831    | 11,269    | 各種電気通信サービス  |

| 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  |                         |
| (香港)                                 |              |       | 千香港ドル     | 千円      |                         |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP            | 百株           | 百株    | 285       | 3,864   | ヘルスケア機器・用品              |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD  | 240          | 240   | —         | —       | 食品                      |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H       | —            | 640   | 382       | 5,181   | 銀行                      |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP          | —            | 120   | 509       | 6,907   | 医薬品                     |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT         | —            | 457   | 1,197     | 16,235  | 飲料                      |
| DALI FOODS GROUP CO LTD              | —            | 810   | 374       | 5,074   | 食品                      |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD       | 55           | —     | —         | —       | 電力                      |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 1,408 | 8,208     | 11,666  | 158,203                 |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 12    | 19        | —       | < 9.0% >                |
| (シンガポール)                             |              |       | 千シンガポールドル |         |                         |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD               | —            | 123   | 122       | 9,712   | 資本市場                    |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 169          | —     | —         | —       | 各種電気通信サービス              |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 169   | 123       | 122     | 9,712                   |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 1     | 1         | —       | < 0.6% >                |
| (マレーシア)                              |              |       | 千リンギ      |         |                         |
| GENTING PLANTATIONS BHD              | —            | 229   | 217       | 5,656   | 食品                      |
| DIGI.COM BERHAD                      | 164          | 555   | 209       | 5,440   | 無線通信サービス                |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD          | —            | 76    | 228       | 5,928   | 飲料                      |
| MALAYAN BANKING                      | 115          | 277   | 221       | 5,747   | 銀行                      |
| MISC BHD                             | —            | 370   | 231       | 6,022   | 海運業                     |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD             | —            | 18    | 245       | 6,388   | 食品                      |
| PPB GROUP BERHAD                     | —            | 128   | 239       | 6,223   | 食品                      |
| PETRONAS DAGANGAN BHD                | —            | 127   | 247       | 6,438   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PETRONAS GAS BERHAD                  | —            | 153   | 247       | 6,444   | ガス                      |
| TELEKOM MALAYSIA                     | —            | 407   | 268       | 6,984   | 各種電気通信サービス              |
| TENAGA NASIONAL                      | 37           | 204   | 205       | 5,335   | 電力                      |
| QL RESOURCES BHD                     | —            | 374   | 225       | 5,863   | 食品                      |
| PUBLIC BANK BHD                      | 52           | —     | —         | —       | 銀行                      |
| IOI CORP                             | —            | 508   | 216       | 5,639   | 食品                      |
| MAXIS BHD                            | 35           | 498   | 240       | 6,253   | 無線通信サービス                |
| IHH HEALTHCARE BHD                   | 91           | 382   | 195       | 5,095   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD               | —            | 488   | 209       | 5,443   | 運送インフラ                  |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 494   | 4,794     | 3,650   | 94,904                  |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 6     | 16        | —       | < 5.4% >                |
| (タイ)                                 |              |       | 千バーツ      |         |                         |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR           | —            | 102   | 1,764     | 6,211   | 無線通信サービス                |
| CP ALL PCL-NVDR                      | 35           | —     | —         | —       | 食品・生活必需品小売り             |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 35    | 102       | 1,764   | 6,211                   |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 1     | 1         | —       | < 0.4% >                |
| (インドネシア)                             |              |       | 千ルピア      |         |                         |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT            | 220          | —     | —         | —       | 家庭用品                    |
| TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK        | 723          | —     | —         | —       | 各種電気通信サービス              |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 943   | —         | —       | —                       |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 2     | —         | —       | < -% >                  |
| (韓国)                                 |              |       | 千ウォン      |         |                         |
| SK TELECOM CO LTD                    | 1            | 3     | 74,046    | 7,056   | 無線通信サービス                |
| SEEGENE, INC.                        | —            | 3     | 53,978    | 5,144   | バイオテクノロジー               |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 1     | 6         | 128,024 | 12,200                  |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 1     | 2         | —       | < 0.7% >                |
| (台湾)                                 |              |       | 千新台幣ドル    |         |                         |
| ASUSTEK COMPUTER INC                 | 10           | 30    | 865       | 3,245   | コンピュータ・周辺機器             |
| TAIWAN BUSINESS BANK                 | 302          | 674   | 626       | 2,349   | 銀行                      |
| CHINA STEEL                          | —            | 650   | 1,521     | 5,703   | 金属・鉱業                   |
| COMPAL ELECTRONICS                   | —            | 730   | 1,598     | 5,995   | コンピュータ・周辺機器             |

| 銘柄                           | 株数      | 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    |             |
| (台湾)                         | 百株      | 百株      | 千新台幣ドル | 千円     |           |             |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD      | 70      | 170     | 1,844  | 6,916  |           | 各種電気通信サービス  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD         | 60      | 160     | 1,555  | 5,832  |           | 無線通信サービス    |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 212     | 872     | 1,523  | 5,711  |           | 銀行          |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD  | 90      | 230     | 1,384  | 5,192  |           | 無線通信サービス    |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO   | 339     | 813     | 1,675  | 6,283  |           | 銀行          |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 90      | 190     | 1,305  | 4,894  |           | 食品          |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP   | 20      | 60      | 1,608  | 6,030  |           | 食品・生活必需品小売り |
| STANDARD FOODS CORP          | 31      | 241     | 1,374  | 5,155  |           | 食品          |
| SYNEX TECHNOLOGY INTL CORP   | —       | 330     | 1,544  | 5,791  |           | 電子装置・機器・部品  |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR         | —       | 50      | 3,160  | 11,850 |           | 半導体・半導体製造装置 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 424     | 900     | 1,764  | 6,617  |           | 銀行          |
| 小 計                          | 株数・金額   | 1,649   | 6,102  | 23,351 | 87,569    |             |
|                              | 銘柄数<比率> | 11      | 15     | —      | <5.0%>    |             |
| (オーストラリア)                    |         |         |        | 千豪ドル   |           |             |
| NEWCREST MINING              | 8       | —       | —      | —      | —         | 金属・鉱業       |
| EVOLUTION MINING LTD         | 261     | —       | —      | —      | —         | 金属・鉱業       |
| 小 計                          | 株数・金額   | 269     | —      | —      | —         |             |
|                              | 銘柄数<比率> | 2       | —      | —      | <—%>      |             |
| (イスラエル)                      |         |         |        | 千新シケル  |           |             |
| BANK HAPOALIM BM             | 42      | —       | —      | —      | —         | 銀行          |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 64      | —       | —      | —      | —         | 銀行          |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 11      | —       | —      | —      | —         | 銀行          |
| AZRIELI GROUP                | 1       | —       | —      | —      | —         | 不動産管理・開発    |
| 小 計                          | 株数・金額   | 120     | —      | —      | —         |             |
|                              | 銘柄数<比率> | 4       | —      | —      | <—%>      |             |
| 合 計                          | 株数・金額   | 7,395   | 22,367 | —      | 1,671,907 |             |
|                              | 銘柄数<比率> | 140     | 151    | —      | <95.2%>   |             |

\*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により邦貨換算したものです。

\*邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\*株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

| 銘柄                             | 期首(前期末)      |        | 当 期 末  |        |        |
|--------------------------------|--------------|--------|--------|--------|--------|
|                                | 口 数          | 口 数    | 評 価 額  |        | 比 率    |
|                                |              |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額 |        |
| (アメリカ)                         | 口            | 口      | 千米ドル   | 千円     | %      |
| AGNC INVESTMENT CORP           | 5,200        | —      | —      | —      | —      |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT      | 9,700        | —      | —      | —      | —      |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC      | 400          | —      | —      | —      | —      |
| CAMDEN PROPERTY TRUST          | 600          | —      | —      | —      | —      |
| CROWN CASTLE INTL CORP         | 700          | —      | —      | —      | —      |
| DUKE REALTY CORP               | 600          | —      | —      | —      | —      |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES    | 1,000        | —      | —      | —      | —      |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC       | 100          | —      | —      | —      | —      |
| EXTRA SPACE STORAGE INC        | 400          | —      | —      | —      | —      |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC      | 400          | —      | —      | —      | —      |
| INVITATION HOMES INC           | 1,800        | —      | —      | —      | —      |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 1,000        | —      | —      | —      | —      |
| PUBLIC STORAGE                 | 500          | 600    | 139    | 14,623 | 0.8    |
| REALTY INCOME CORP             | 1,200        | —      | —      | —      | —      |
| UDR INC                        | 1,100        | —      | —      | —      | —      |
| VENTAS INC                     | 300          | —      | —      | —      | —      |
| WP CAREY INC                   | 1,000        | —      | —      | —      | —      |
| 小 計                            | 口 数 ・ 金 額    | 26,000 | 600    | 139    | 14,623 |
|                                | 銘柄 数 < 比 率 > | 17     | 1      | —      | <0.8%> |
| (香港)                           |              |        | 千香港ドル  |        |        |
| LINK REIT                      | 7,300        | 8,100  | 545    | 7,391  | 0.4    |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS    | —            | 79,500 | 603    | 8,182  | 0.5    |
| 小 計                            | 口 数 ・ 金 額    | 7,300  | 87,600 | 1,148  | 15,574 |
|                                | 銘柄 数 < 比 率 > | 1      | 2      | —      | <0.9%> |
| 合 計                            | 口 数 ・ 金 額    | 33,300 | 88,200 | —      | 30,198 |
|                                | 銘柄 数 < 比 率 > | 18     | 3      | —      | <1.7%> |

\* 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により邦貨換算したものです。

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○投資信託財産の構成

(2021年2月15日現在)

| 項 目          | 当 期 末           |           |
|--------------|-----------------|-----------|
|              | 評 価 額           | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>1,671,907 | %<br>95.2 |
| 投資証券         | 30,198          | 1.7       |
| コール・ローン等、その他 | 53,262          | 3.1       |
| 投資信託財産総額     | 1,755,367       | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産（1,710,586千円）の投資信託財産総額（1,755,367千円）に対する比率は97.4%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=105.12円、1カナダドル=82.84円、1英ポンド=145.85円、1スイスフラン=117.85円、1スウェーデンクローナ=12.66円、1ノルウェークローネ=12.44円、1デンマーククローネ=17.13円、1トルコリラ=14.97円、1ユーロ=127.44円、1香港ドル=13.56円、1シンガポールドル=79.36円、1リンギ=26.00円、1パーツ=3.52円、1フィリピンペソ=2.19円、1ウォン=0.0953円、1新台幣ドル=3.75円、1豪ドル=81.60円、1ニュージーランドドル=75.90円、1新シッケル=32.31円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年2月15日現在)

| 項 目             | 当 期 末              |
|-----------------|--------------------|
| (A) 資産          | 円<br>1,755,367,085 |
| コール・ローン等        | 52,112,618         |
| 株式(評価額)         | 1,671,907,778      |
| 投資証券(評価額)       | 30,198,007         |
| 未収配当金           | 1,148,682          |
| (B) 負債          | 12                 |
| 未払利息            | 12                 |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 1,755,367,073      |
| 元本              | 1,194,520,561      |
| 次期繰越損益金         | 560,846,512        |
| (D) 受益権総口数      | 1,194,520,561口     |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,695円            |

(注) 期首元本額は707,293,175円、期中追加設定元本額は924,281,591円、期中一部解約元本額は437,054,205円、1口当たり純資産額は1.4695円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額  
・オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用) 667,168,701円  
・野村オール海外ストック最小分散ポートフォリオ(適格機関投資家専用) 290,302,011円  
・ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式 221,152,698円  
・野村オールウェザー・ファクターアロケーションファンド(非課税適格機関投資家専用) 15,897,151円

## ○損益の状況 (2020年2月14日~2021年2月15日)

| 項 目              | 当 期             |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益        | 円<br>47,284,314 |
| 受取配当金            | 47,194,746      |
| 受取利息             | 5,049           |
| その他収益金           | 99,581          |
| 支払利息             | △ 15,062        |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 17,508,535    |
| 売買益              | 230,242,778     |
| 売買損              | △247,751,313    |
| (C) 保管費用等        | △ 3,658,758     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 26,117,021      |
| (E) 前期繰越損益金      | 364,565,125     |
| (F) 追加信託差損益金     | 360,317,647     |
| (G) 解約差損益金       | △190,153,281    |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 560,846,512     |
| 次期繰越損益金(H)       | 560,846,512     |

\*損益の状況の中で(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。

\*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、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をいいます。

\*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 野村グローバル株IPストラテジー マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日2020年9月10日）

作成対象期間（2019年9月11日～2020年9月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。株式への投資にあたっては、企業の収益力と当該企業が行う投資の關係に着目した独自の評価尺度を用いて銘柄の魅力度評価を行い、投資候補銘柄を選別します。<br>外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。  |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。  |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額   |       | 参考指数   |       | 株組入比率 | 株先物比率 | 純資産額       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|------------|
|                | 円      | 騰落率   | 100    | 騰落率   |       |       |            |
| 2期(2016年9月12日) | 11,458 | △ 7.0 | 105.22 | △ 8.0 | 99.2  | —     | 百万円<br>338 |
| 3期(2017年9月11日) | 13,695 | 19.5  | 131.10 | 24.6  | 99.4  | —     | 523        |
| 4期(2018年9月10日) | 16,264 | 18.8  | 149.49 | 14.0  | 95.8  | 3.4   | 774        |
| 5期(2019年9月10日) | 16,605 | 2.1   | 151.38 | 1.3   | 99.3  | —     | 1,566      |
| 6期(2020年9月10日) | 18,445 | 11.1  | 168.13 | 11.1  | 99.3  | —     | 1,825      |

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*参考指数(=MSCI ワールド・インデックス(税引前配当込み・円換算ベース・為替ヘッジなし))は、MSCI ワールド・インデックス(税引前配当込み・ドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。  
 \*参考指数の計算にあたっては、委託会社において、ファンドにおける組入資産・為替の評価時点に合わせて計算を行いません。なお、設定時を100として指数化しております。  
 \*MSCI ワールド・インデックスは、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数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。  
 (出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

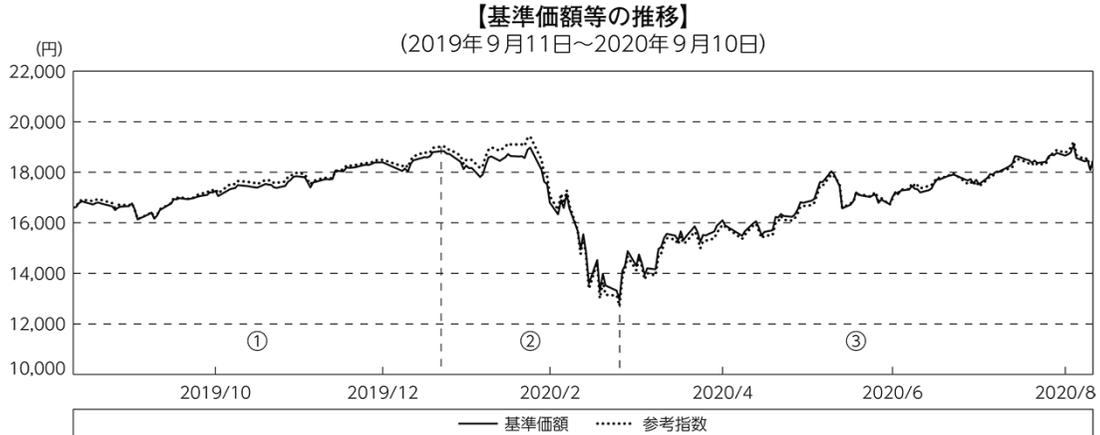
| 年月日                | 基準価額   |       | 参考指数   |       | 株組入比率 | 株先物比率 |
|--------------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
|                    | 円      | 騰落率   | 100    | 騰落率   |       |       |
| (期首)<br>2019年9月10日 | 16,605 | —     | 151.38 | —     | 99.3  | —     |
| 9月末                | 16,654 | 0.3   | 152.10 | 0.5   | 99.1  | —     |
| 10月末               | 17,262 | 4.0   | 157.99 | 4.4   | 99.3  | —     |
| 11月末               | 17,843 | 7.5   | 163.87 | 8.2   | 99.7  | —     |
| 12月末               | 18,398 | 10.8  | 168.59 | 11.4  | 99.1  | —     |
| 2020年1月末           | 18,164 | 9.4   | 168.52 | 11.3  | 99.2  | —     |
| 2月末                | 16,806 | 1.2   | 155.51 | 2.7   | 97.6  | 1.5   |
| 3月末                | 14,741 | △11.2 | 133.34 | △11.9 | 95.1  | 3.9   |
| 4月末                | 16,093 | △ 3.1 | 145.18 | △ 4.1 | 96.0  | 3.6   |
| 5月末                | 16,792 | 1.1   | 151.93 | 0.4   | 95.8  | 3.6   |
| 6月末                | 17,001 | 2.4   | 154.50 | 2.1   | 98.0  | 1.4   |
| 7月末                | 17,523 | 5.5   | 158.99 | 5.0   | 99.6  | —     |
| 8月末                | 18,656 | 12.4  | 171.07 | 13.0  | 99.5  | —     |
| (期末)<br>2020年9月10日 | 18,445 | 11.1  | 168.13 | 11.1  | 99.3  | —     |

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) 参考指数は、MSCI ワールド・インデックス（税引前配当込み・円換算ベース・為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

#### ①の局面（期首～1月中旬）

(上 昇) 米中貿易協議再開への期待や、米国によるメキシコ関税発動が見送られたこと、FOMC（米連邦公開市場委員会）で政策金利の据え置きが決まり低金利政策が当面維持されるとの見方が強まったことなどから投資家のリスク選好姿勢が強まったこと。

#### ②の局面（1月下旬～3月中旬）

(下 落) 新型コロナウイルスの世界的な感染拡大が警戒されリスク回避の動きが強まったこと。その後、新型コロナウイルス感染者数の急拡大を受け、WHO（世界保健機関）がパンデミック（世界的な大流行）を表明したことで、世界的な経済活動の停滞による景気後退への懸念が高まったこと。

#### ③の局面（3月下旬～期末）

(上 昇) 各国中央銀行が金融市場への大規模な下支え策を発表したことなどから、先行きに対する過度な不安が和らいだこと。新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや、各国の経済活動再開による景気回復期待が高まったこと。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

運用の基本方針に基づき期を通じて高位を維持し、期末は99.3%としました。

### ・期中の主な動き

投資候補銘柄を企業の収益力と企業が行う投資に基づいて評価し、時価総額、流動性、財務リスク等を勘案した上でポートフォリオの見直しを行ないました。

## ○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おりません。

コメントおよびグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としているMSCI ワールド・インデックス（税引前配当込み・円換算ベース・為替ヘッジなし）の騰落率が11.1%になったのに対し、基準価額の騰落率は11.1%となりました。

### (主なプラス要因)

企業の収益性の観点から評価が高い銘柄群の騰落率が参考指数よりも高かったこと。

投資比率の低い金融セクターの騰落率が参考指数よりも低かったこと。

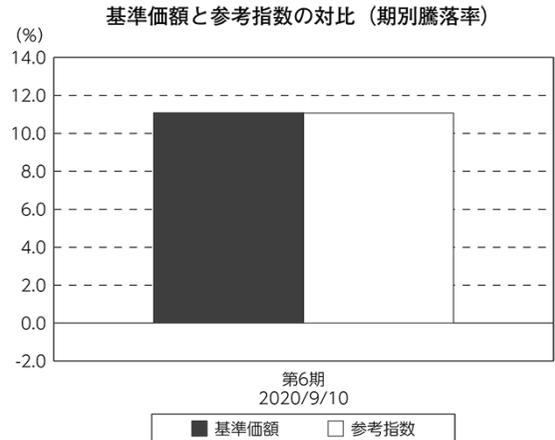
### (主なマイナス要因)

企業の投資の観点から評価が高い銘柄群の騰落率が参考指数よりも低かったこと。

投資比率の低い情報技術セクターの騰落率が参考指数よりも高かったこと。

## ◎今後の運用方針

引き続き、企業の収益力と企業が行う投資の観点から評価が高い銘柄群を基にポートフォリオを構築することで、中長期的な値上がり益の獲得を目指します。



(注) 参考指数は、MSCI ワールド・インデックス（税引前配当込み・円換算ベース・為替ヘッジなし）です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年9月11日～2020年9月10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>7<br>(6)<br>(0) | %<br>0.039<br>(0.037)<br>(0.002) | (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                                   |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税<br>( 株 式 )               | 3<br>(3)             | 0.018<br>(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                                    |
| (c) そ の 他 費 用<br>( 保 管 費 用 )<br>( そ の 他 )  | 27<br>(27)<br>(0)    | 0.158<br>(0.157)<br>(0.001)      | (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>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計  | 37                   | 0.215                            |  |
| 期中の平均基準価額は、17,161円です。                      |                      |                                  |  |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2019年9月11日～2020年9月10日)

## 株式

|        |         | 買 付                  |                                     | 売 付                 |                        |
|--------|---------|----------------------|-------------------------------------|---------------------|------------------------|
|        |         | 株 数                  | 金 額                                 | 株 数                 | 金 額                    |
| 国<br>内 | 上場      | 千株<br>27<br>( 0.7)   | 千円<br>72,774<br>( -)                | 千株<br>25            | 千円<br>54,035           |
|        | アメリカ    | 百株<br>1,500<br>( 46) | 千米ドル<br>8,525<br>( 15)              | 百株<br>1,309<br>( 3) | 千米ドル<br>8,427<br>( 16) |
| 外<br>国 | カナダ     | 37                   | 千カナダドル<br>161                       | 55                  | 千カナダドル<br>124          |
|        | イギリス    | 761<br>( -)          | 千英ポンド<br>399<br>( $\Delta$ 0.27795) | 693                 | 千英ポンド<br>306           |
|        | スイス     | 23                   | 千スイスフラン<br>403                      | 11                  | 千スイスフラン<br>272         |
|        | スウェーデン  | 69                   | 千スウェーデンクローナ<br>1,216                | 62                  | 千スウェーデンクローナ<br>901     |
|        | ノルウェー   | 21                   | 千ノルウェークローネ<br>298                   | -                   | 千ノルウェークローネ<br>-        |
|        | デンマーク   | 22                   | 千デンマーククローネ<br>1,215                 | 31                  | 千デンマーククローネ<br>1,604    |
|        | ユーロ     |                      | 千ユーロ                                |                     | 千ユーロ                   |
|        | ドイツ     | 69<br>( -)           | 238<br>( $\Delta$ 0.513)            | 69                  | 304                    |
|        | イタリア    | 132                  | 38                                  | 16                  | 29                     |
|        | フランス    | 14<br>( -)           | 114<br>( $\Delta$ 0.055)            | 59                  | 195                    |
|        | オランダ    | 179<br>( 0.31)       | 122<br>( -)                         | 106                 | 135                    |
|        | スペイン    | 0.37                 | 5                                   | 0.38                | 2                      |
|        | ベルギー    | 4                    | 26                                  | -                   | -                      |
|        | オーストリア  | 1                    | 5                                   | -                   | -                      |
|        | フィンランド  | 9<br>( 9)            | 24<br>( -)                          | 25                  | 35                     |
|        | アイルランド  | 0.93<br>( 0.03)      | 10<br>( -)                          | -                   | -                      |
|        | 香港      | 187<br>( 22)         | 千香港ドル<br>216<br>( -)                | 85                  | 千香港ドル<br>105           |
|        | シンガポール  | 64                   | 千シンガポールドル<br>26                     | -                   | 千シンガポールドル<br>-         |
|        | オーストラリア | 142<br>( 6)          | 千豪ドル<br>268<br>( 7)                 | 115<br>( 3)         | 千豪ドル<br>302<br>( 2)    |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 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    |
| 外 国   | 株式先物取引 | 百万円<br>562 | 百万円<br>568 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

\*単位未満は切り捨て。

\*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

(2019年9月11日～2020年9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       | 2,425,369千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 1,847,635千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.31        |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年9月11日～2020年9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

(2020年9月10日現在)

## 国内株式

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |
|------------------------|---------|-------|-------|
|                        | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |
|                        | 千株      | 千株    | 千円    |
| <b>食料品 (14.7%)</b>     |         |       |       |
| 山崎製パン                  | 1.2     | 1.5   | 2,634 |
| カルビー                   | 0.1     | 0.1   | 333   |
| ヤクルト本社                 | —       | 0.1   | 564   |
| 明治ホールディングス             | 0.4     | 0.5   | 3,995 |
| キリンホールディングス            | 1.7     | 2.7   | 5,440 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ   | 0.6     | 0.6   | 1,062 |
| キッコーマン                 | 0.3     | 0.4   | 2,300 |
| 東洋水産                   | 0.1     | 0.2   | 1,130 |
| 日清食品ホールディングス           | 0.3     | 0.3   | 2,988 |
| <b>繊維製品 (1.6%)</b>     |         |       |       |
| 帝人                     | 1       | 1.3   | 2,215 |
| <b>化学 (12.6%)</b>      |         |       |       |
| 花王                     | 1       | 1     | 8,021 |
| 富士フイルムホールディングス         | —       | 0.2   | 999   |
| 資生堂                    | 0.7     | 0.8   | 4,933 |
| ライオン                   | 0.6     | 0.9   | 2,004 |
| ポーラ・オルビスホールディングス       | 0.2     | 0.8   | 1,608 |
| <b>医薬品 (12.4%)</b>     |         |       |       |
| 協和キリン                  | 0.4     | 0.4   | 1,135 |
| 武田薬品工業                 | 0.5     | —     | —     |
| アステラス製薬                | 2.5     | 2.8   | 4,508 |
| 大日本住友製薬                | 0.7     | 0.7   | 943   |
| 塩野義製薬                  | 0.3     | 0.4   | 2,319 |
| エーザイ                   | 0.7     | 0.6   | 5,538 |
| 第一三共                   | 0.5     | 0.2   | 1,892 |
| 大塚ホールディングス             | —       | 0.2   | 903   |
| <b>ゴム製品 (1.2%)</b>     |         |       |       |
| ブリヂストン                 | —       | 0.5   | 1,721 |
| <b>ガラス・土石製品 (0.4%)</b> |         |       |       |
| 太平洋セメント                | 0.2     | 0.2   | 577   |
| <b>機械 (0.5%)</b>       |         |       |       |
| セガサミーホールディングス          | 0.2     | 0.6   | 755   |
| <b>電気機器 (27.5%)</b>    |         |       |       |
| コニカミノルタ                | 2.3     | —     | —     |
| ブラザー工業                 | 0.1     | 0.1   | 177   |
| 日立製作所                  | 0.1     | 1.2   | 4,455 |
| 富士電機                   | 0.3     | 0.5   | 1,762 |
| オムロン                   | 0.4     | 0.4   | 3,224 |
| 日本電気                   | 1.2     | 0.5   | 2,810 |
| 富士通                    | 0.6     | 0.6   | 8,082 |
| ルネサスエレクトロニクス           | 0.9     | 1.7   | 1,334 |
| セイコーエプソン               | 1.1     | 1.5   | 1,884 |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |         |
|----------------------|---------|-------|-------|---------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |
|                      | 千株      | 千株    | 千円    |         |
| パナソニック               | 5.1     | 5.8   | 5,705 |         |
| 横河電機                 | 0.9     | 1.2   | 2,145 |         |
| カシオ計算機               | 0.8     | 1.1   | 1,886 |         |
| キヤノン                 | 1.6     | 1.8   | 3,150 |         |
| リコー                  | 2.3     | 2.3   | 1,752 |         |
| <b>輸送用機器 (1.4%)</b>  |         |       |       |         |
| 三菱自動車工業              | 0.4     | 0.4   | 104   |         |
| スズキ                  | —       | 0.4   | 1,822 |         |
| <b>精密機器 (10.1%)</b>  |         |       |       |         |
| ニコン                  | 0.8     | 0.8   | 607   |         |
| オリンパス                | 4.1     | 3.4   | 7,082 |         |
| HOYA                 | 0.5     | 0.6   | 6,327 |         |
| <b>その他製品 (1.8%)</b>  |         |       |       |         |
| パンダイナムコホールディングス      | 0.3     | 0.3   | 2,004 |         |
| ヤマハ                  | 0.1     | 0.1   | 487   |         |
| <b>電気・ガス業 (2.0%)</b> |         |       |       |         |
| 東邦瓦斯                 | 0.6     | 0.6   | 2,757 |         |
| <b>情報・通信業 (6.5%)</b> |         |       |       |         |
| 日本電信電話               | 0.6     | 1.3   | 3,065 |         |
| NTTドコモ               | 1.6     | 2.1   | 5,975 |         |
| <b>小売業 (2.2%)</b>    |         |       |       |         |
| 三越伊勢丹ホールディングス        | 0.3     | 0.3   | 171   |         |
| セブン&アイ・ホールディングス      | —       | 0.4   | 1,340 |         |
| ヤマダ電機                | 2.8     | 2.8   | 1,548 |         |
| <b>銀行業 (0.3%)</b>    |         |       |       |         |
| 新生銀行                 | 0.7     | —     | —     |         |
| あおぞら銀行               | 0.2     | 0.2   | 373   |         |
| りそなホールディングス          | 4.4     | —     | —     |         |
| <b>保険業 (3.9%)</b>    |         |       |       |         |
| SOMPOホールディングス        | —       | 0.2   | 780   |         |
| 第一生命ホールディングス         | 0.8     | 1.7   | 2,655 |         |
| 東京海上ホールディングス         | —       | 0.4   | 1,972 |         |
| <b>サービス業 (0.9%)</b>  |         |       |       |         |
| カカコム                 | 0.2     | 0.2   | 510   |         |
| ベネッセホールディングス         | 0.3     | 0.3   | 798   |         |
| 合 計                  | 株 数・金 額 | 50    | 53    | 139,277 |
|                      | 銘柄数<比率> | 53    | 57    | <7.6%>  |

\*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいてい  
ます。

\*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。

\*評価総額の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 外国株式

| 銘柄                           | 期首(前期末) |      | 当期    |        | 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     |    |  |                   |
| ABBVIE INC                   | 16      | 0.45 | 4     | 437    |    |  | バイオテクノロジー         |
| ACUITY BRANDS INC            | 2       | —    | —     | —      |    |  | 電気設備              |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 1       | 2    | 38    | 4,131  |    |  | 専門小売り             |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 23      | 16   | 136   | 14,486 |    |  | 半導体・半導体製造装置       |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 6       | 1    | 16    | 1,716  |    |  | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 3       | 4    | 72    | 7,716  |    |  | 資本市場              |
| AMGEN INC                    | 4       | 6    | 158   | 16,876 |    |  | バイオテクノロジー         |
| APPLE INC                    | —       | 53   | 625   | 66,408 |    |  | コンピュータ・周辺機器       |
| AUTODESK INC.                | 5       | 4    | 95    | 10,137 |    |  | ソフトウェア            |
| AUTOLIV INC                  | 1       | 5    | 42    | 4,468  |    |  | 自動車部品             |
| AUTOZONE                     | 0.68    | 0.59 | 72    | 7,727  |    |  | 専門小売り             |
| AVERY DENNISON CORP          | 5       | 3    | 46    | 4,894  |    |  | 容器・包装             |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.    | 8       | 8    | 74    | 7,886  |    |  | ヘルスケア機器・用品        |
| BEST BUY COMPANY INC         | 11      | 9    | 100   | 10,625 |    |  | 専門小売り             |
| BIOGEN INC                   | —       | 3    | 81    | 8,683  |    |  | バイオテクノロジー         |
| BLACKROCK INC                | 0.67    | 1    | 104   | 11,126 |    |  | 資本市場              |
| H & R BLOCK INC              | 20      | —    | —     | —      |    |  | 各種消費者サービス         |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 0.32    | 0.59 | 110   | 11,725 |    |  | インターネット販売・通信販売    |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 25      | —    | —     | —      |    |  | 医薬品               |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B       | 6       | 7    | 59    | 6,300  |    |  | 飲料                |
| BURLINGTON STORES INC        | 2       | 2    | 50    | 5,364  |    |  | 専門小売り             |
| CBS CORP-CL B                | 3       | —    | —     | —      |    |  | メディア              |
| CDK GLOBAL INC               | —       | 2    | 13    | 1,419  |    |  | ソフトウェア            |
| CDW CORPORATION              | —       | 1    | 13    | 1,409  |    |  | 電子装置・機器・部品        |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 3       | 4    | 48    | 5,163  |    |  | 航空貨物・物流サービス       |
| CABOT OIL & GAS CORP         | —       | 12   | 23    | 2,514  |    |  | 石油・ガス・消耗燃料        |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 17      | 10   | 105   | 11,238 |    |  | ソフトウェア            |
| CAMPBELL SOUP CO             | —       | 5    | 26    | 2,799  |    |  | 食品                |
| CATERPILLAR INC DEL          | —       | 7    | 113   | 12,050 |    |  | 機械                |
| CERNER CORP                  | —       | 6    | 44    | 4,774  |    |  | ヘルスケア・テクノロジー      |
| CISCO SYSTEMS                | 21      | 39   | 158   | 16,862 |    |  | 通信機器              |
| CINTAS CORP                  | 2       | 2    | 83    | 8,897  |    |  | 商業サービス・用品         |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 3       | 5    | 76    | 8,102  |    |  | ソフトウェア            |
| CLOROX CO                    | 4       | 3    | 73    | 7,781  |    |  | 家庭用品              |
| COCA COLA CO                 | 22      | 32   | 160   | 17,081 |    |  | 飲料                |
| COLGATE PALMOLIVE CO.        | 26      | 21   | 165   | 17,583 |    |  | 家庭用品              |
| CONAGRA BRANDS INC           | 1       | —    | —     | —      |    |  | 食品                |
| CONOCOPHILLIPS               | 16      | 24   | 84    | 9,026  |    |  | 石油・ガス・消耗燃料        |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 3       | 3    | 123   | 13,100 |    |  | 食品・生活必需品小売り       |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 0.02    | —    | —     | —      |    |  | ホテル・レストラン・レジャー    |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 4       | 6    | 29    | 3,157  |    |  | ヘルスケア機器・用品        |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 5       | —    | —     | —      |    |  | 複合小売り             |
| DOLLAR TREE INC              | 3       | —    | —     | —      |    |  | 複合小売り             |
| DOMINOS PIZZA INC            | 2       | 1    | 62    | 6,615  |    |  | ホテル・レストラン・レジャー    |
| DOVER CORP                   | 4       | 3    | 43    | 4,631  |    |  | 機械                |
| EATON VANCE CORP             | 1       | —    | —     | —      |    |  | 資本市場              |
| EBAY INC                     | 11      | 19   | 102   | 10,858 |    |  | インターネット販売・通信販売    |
| ECOLAB INC                   | 0.89    | 3    | 70    | 7,525  |    |  | 化学                |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | —       | 8    | 75    | 8,056  |    |  | ヘルスケア機器・用品        |
| EMERSON ELEC                 | 19      | 19   | 136   | 14,521 |    |  | 電気設備              |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | —       | 0.42 | 9     | 984    |    |  | 保険                |
| FAIR ISAAC CORP              | —       | 0.52 | 21    | 2,318  |    |  | ソフトウェア            |
| FASTENAL CO                  | 20      | 21   | 97    | 10,348 |    |  | 商社・流通業            |

| 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     |                         |
| F5 NETWORKS INC                 | 3       | 3    | 39    | 4,217  | 通信機器                    |
| FLOWSERVE CORP                  | 5       | —    | —     | —      | 機械                      |
| GAP INC                         | 20      | —    | —     | —      | 専門小売り                   |
| GENERAL ELEC CO                 | 7       | 162  | 99    | 10,615 | コングロマリット                |
| GILEAD SCIENCES INC             | —       | 16   | 108   | 11,532 | バイオテクノロジー               |
| GRAINGER(W.W.) INC              | 3       | 3    | 113   | 12,049 | 商社・流通業                  |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC          | 14      | 17   | 74    | 7,964  | 商社・流通業                  |
| HP INC                          | 46      | 45   | 89    | 9,531  | コンピュータ・周辺機器             |
| HASBRO INC                      | 4       | 5    | 44    | 4,694  | レジャー用品                  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC     | —       | 0.87 | 13    | 1,485  | 情報技術サービス                |
| HERSHEY CO/THE                  | 6       | 6    | 93    | 9,947  | 食品                      |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE      | 25      | 37   | 35    | 3,748  | コンピュータ・周辺機器             |
| HOLOGIC INC                     | 4       | 8    | 51    | 5,442  | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT                      | 13      | 9    | 263   | 27,985 | 専門小売り                   |
| HUMANA INC                      | 1       | 1    | 77    | 8,238  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| IDEXX LABORATORIES INC          | 2       | 2    | 99    | 10,531 | ヘルスケア機器・用品              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC         | 5       | 7    | 149   | 15,877 | 機械                      |
| INGREDION INC                   | 1       | 2    | 23    | 2,516  | 食品                      |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 8       | —    | —     | —      | 情報技術サービス                |
| INTUIT INC                      | 7       | 5    | 172   | 18,372 | ソフトウェア                  |
| JOHNSON & JOHNSON               | 12      | 16   | 243   | 25,871 | 医薬品                     |
| JUNIPER NETWORKS INC            | 9       | 13   | 32    | 3,419  | 通信機器                    |
| KELLOGG CO                      | —       | 3    | 23    | 2,494  | 食品                      |
| KIMBERLY-CLARK CORP             | 9       | 8    | 126   | 13,416 | 家庭用品                    |
| KOHL'S CORP                     | 7       | —    | —     | —      | 複合小売り                   |
| KROGER CO                       | 24      | 23   | 81    | 8,647  | 食品・生活必需品小売り             |
| L BRANDS, INC                   | 13      | —    | —     | —      | 専門小売り                   |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC       | 0.23    | —    | —     | —      | 航空宇宙・防衛                 |
| LAM RESEARCH                    | —       | 1    | 58    | 6,232  | 半導体・半導体製造装置             |
| LAS VEGAS SANDS CORP            | 2       | 8    | 44    | 4,779  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A     | 5       | 5    | 117   | 12,463 | パーソナル用品                 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC        | 2       | 2    | 60    | 6,447  | 建設関連製品                  |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP          | 8       | 11   | 41    | 4,364  | メディア                    |
| ELI LILLY & CO.                 | 10      | 10   | 156   | 16,626 | 医薬品                     |
| LOWES COS INC                   | 13      | 10   | 163   | 17,368 | 専門小売り                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC         | 2       | 2    | 83    | 8,877  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| MSCI INC                        | 1       | 1    | 59    | 6,333  | 資本市場                    |
| MACYS INC                       | 23      | —    | —     | —      | 複合小売り                   |
| MANPOWERGROUP INC               | 3       | —    | —     | —      | 専門サービス                  |
| MARATHON OIL CORP               | 7       | —    | —     | —      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MASCO CORP                      | 18      | 17   | 103   | 11,024 | 建設関連製品                  |
| MATCH GROUP INC                 | —       | 4    | 50    | 5,404  | インタラクティブ/メディアおよびサービス    |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS       | 4       | 8    | 53    | 5,697  | 半導体・半導体製造装置             |
| MCDONALD'S CORP                 | 6       | —    | —     | —      | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR      | 5       | 7    | 13    | 1,417  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MERCK & CO INC                  | 28      | 27   | 233   | 24,775 | 医薬品                     |
| METTLER-TOLEDO INTL             | 1       | 0.88 | 85    | 9,121  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| MONSTER BEVERAGE CORP           | 5       | 8    | 68    | 7,320  | 飲料                      |
| MOODYS CORP                     | 4       | 4    | 142   | 15,164 | 資本市場                    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC          | 5       | 4    | 76    | 8,107  | 通信機器                    |
| NRG ENERGY INC                  | —       | 8    | 27    | 2,877  | 電力                      |
| NVR INC                         | 0.05    | —    | —     | —      | 家庭用耐久財                  |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC      | 5       | 31   | 36    | 3,878  | エネルギー設備・サービス            |
| NETAPP INC                      | 8       | 13   | 62    | 6,633  | コンピュータ・周辺機器             |
| NEWELL BRANDS INC               | —       | 11   | 18    | 1,961  | 家庭用耐久財                  |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I          | 5       | 13   | 20    | 2,148  | メディア                    |

| 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     |                         |
| NIKE INC-B                    | 16      | 16   | 186   | 19,857 | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NORDSON CORP                  | —       | 0.49 | 9     | 987    | 機械                      |
| NORDSTROM INC                 | 8       | —    | —     | —      | 複合小売り                   |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,       | 2       | 1    | 87    | 9,308  | 専門小売り                   |
| ORACLE CORPORATION            | —       | 19   | 112   | 11,898 | ソフトウェア                  |
| PPG INDUSTRIES                | 5       | 5    | 64    | 6,856  | 化学                      |
| PVH CORP                      | 3       | —    | —     | —      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| PTC INC                       | 1       | —    | —     | —      | ソフトウェア                  |
| PEPSICO INC                   | 15      | 15   | 208   | 22,180 | 飲料                      |
| PFIZER INC                    | 33      | 46   | 167   | 17,766 | 医薬品                     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   | 19      | 19   | 152   | 16,240 | タバコ                     |
| PROCTER & GAMBLE CO           | 15      | 17   | 239   | 25,401 | 家庭用品                    |
| QUALCOMM INC                  | 13      | 14   | 168   | 17,888 | 半導体・半導体製造装置             |
| RPM INTERNATIONAL INC         | —       | 3    | 26    | 2,803  | 化学                      |
| RALPH LAUREN CORPORATION      | 4       | 4    | 30    | 3,201  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 15      | 14   | 73    | 7,843  | 専門サービス                  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 4       | 4    | 91    | 9,756  | 電気設備                    |
| ROLLINS INC                   | 7       | 8    | 46    | 4,917  | 商業サービス・用品               |
| ROSS STORES INC               | 6       | 6    | 61    | 6,552  | 専門小売り                   |
| S&P GLOBAL INC                | 3       | 4    | 140   | 14,946 | 資本市場                    |
| HENRY SCHEIN INC              | 1       | 7    | 46    | 4,939  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SEALED AIR CORP               | 15      | 13   | 51    | 5,426  | 容器・包装                   |
| SHERWIN-WILLIAMS              | 2       | 1    | 113   | 12,023 | 化学                      |
| STIRIUS XM HOLDINGS INC       | 39      | 58   | 33    | 3,526  | メディア                    |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | —       | 2    | 38    | 4,063  | 半導体・半導体製造装置             |
| SMITH (A. O.) CORP            | —       | 6    | 29    | 3,172  | 建設関連製品                  |
| SNAP-ON INC                   | 0.44    | 1    | 16    | 1,709  | 機械                      |
| SYSCO CORP                    | 13      | 14   | 87    | 9,244  | 食品・生活必需品小売り             |
| TJX COS INC                   | 23      | 18   | 101   | 10,749 | 専門小売り                   |
| TAPESTRY INC                  | 11      | —    | —     | —      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| TARGET CORP                   | 11      | 9    | 135   | 14,418 | 複合小売り                   |
| TERADYNE INC                  | —       | 5    | 41    | 4,401  | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXAS INSTRUMENTS INC         | 17      | 15   | 220   | 23,471 | 半導体・半導体製造装置             |
| 3M CORP                       | 7       | 7    | 117   | 12,514 | コングロマーット                |
| TIFFANY & CO                  | 3       | 3    | 43    | 4,575  | 専門小売り                   |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY        | 3       | 3    | 49    | 5,308  | 専門小売り                   |
| TRIPADVISOR INC               | 6       | —    | —     | —      | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ULTA BEAUTY INC               | 0.94    | —    | —     | —      | 専門小売り                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C      | 2       | —    | —     | —      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| V F CORP                      | 11      | 12   | 88    | 9,360  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC    | 2       | 1    | 34    | 3,661  | ヘルスケア機器・用品              |
| VERISIGN INC                  | 0.54    | 2    | 49    | 5,277  | 情報技術サービス                |
| VIACOM INC-CLASS B            | 4       | —    | —     | —      | 娯楽                      |
| VMWARE INC - CLASS A          | —       | 0.19 | 2     | 282    | ソフトウェア                  |
| WALMART INC                   | 21      | 17   | 240   | 25,557 | 食品・生活必需品小売り             |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC  | 13      | 15   | 54    | 5,801  | 食品・生活必需品小売り             |
| WATERS CORP                   | —       | 2    | 44    | 4,775  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| WESTERN UNION CO              | —       | 12   | 27    | 2,892  | 情報技術サービス                |
| XILINX INC                    | 4       | 6    | 67    | 7,165  | 半導体・半導体製造装置             |
| XEROX HOLDINGS CORP           | 22      | —    | —     | —      | コンピュータ・周辺機器             |
| YUM BRANDS INC                | 18      | 11   | 111   | 11,804 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A  | 1       | 1    | 43    | 4,606  | 電子装置・機器・部品              |
| ALKERMES PLC                  | 10      | —    | —     | —      | バイオテクノロジー               |
| ALLEGION PLC                  | 1       | 1    | 18    | 1,960  | 建設関連製品                  |
| AON PLC                       | —       | 3    | 72    | 7,743  | 保険                      |
| AON PLC                       | 1       | —    | —     | —      | 保険                      |

| 銘柄                           | 株数               | 株数           | 期末           |             | 業種等                  |
|------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|----------------------|
|                              |                  |              | 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          |                      |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 6                | —            | —            | —           | 情報技術サービス             |
| CAPRI HOLDINGS LTD           | 9                | —            | —            | —           | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| EATON CORP PLC               | 2                | 4            | 49           | 5,305       | 電気設備                 |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 0.84             | —            | —            | —           | 機械                   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC         | —                | 14           | 20           | 2,209       | 専門サービス               |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 8                | 10           | 50           | 5,362       | コンピュータ・周辺機器          |
| PENTAIR PLC                  | 11               | 12           | 54           | 5,779       | 機械                   |
| GARMIN LTD                   | 3                | —            | —            | —           | 家庭用耐久財               |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 2                | —            | —            | —           | 化学                   |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,289<br>145 | 1,523<br>138 | 11,717<br>— | 1,244,662<br><68.2%> |
| (カナダ)                        |                  |              | 千カナダドル       |             |                      |
| BLACKBERRY LTD               | 27               | —            | —            | —           | ソフトウェア               |
| CI FINANCIAL CORP            | 4                | 10           | 18           | 1,531       | 資本市場                 |
| DOLLARAMA INC                | 7                | —            | —            | —           | 複合小売り                |
| EMPIRE CO LTD A              | 20               | 21           | 74           | 6,039       | 食品・生活必需品小売り          |
| LOBLAW COMPANIES             | —                | 7            | 52           | 4,259       | 食品・生活必需品小売り          |
| WESTON(GEORGE)LTD            | —                | 1            | 19           | 1,545       | 食品・生活必需品小売り          |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 60<br>4      | 42<br>4      | 165<br>—    | 13,376<br><0.7%>     |
| (イギリス)                       |                  |              | 千英ポンド        |             |                      |
| SCHRODERS PLC                | —                | 1            | 4            | 629         | 資本市場                 |
| LEGAL & GENERAL              | —                | 44           | 8            | 1,216       | 保険                   |
| PEARSON                      | 22               | 31           | 17           | 2,389       | メディア                 |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 12               | 7            | 12           | 1,682       | ヘルスケア機器・用品           |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 28               | 12           | 19           | 2,653       | 医薬品                  |
| ASTRAZENECA PLC              | —                | 6            | 52           | 7,242       | 医薬品                  |
| MARKS & SPENCER PLC          | 84               | —            | —            | —           | 複合小売り                |
| BURBERRY GROUP PLC           | 14               | 26           | 38           | 5,373       | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| NEXT PLC                     | 2                | 3            | 20           | 2,888       | 複合小売り                |
| KINGFISHER PLC               | 70               | 72           | 19           | 2,757       | 専門小売り                |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 2                | 8            | 21           | 3,014       | 保険                   |
| UNILEVER PLC                 | 1                | 5            | 24           | 3,435       | パーソナル用品              |
| WHITBREAD PLC                | 2                | —            | —            | —           | ホテル・レストラン・レジャー       |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 12               | 18           | 30           | 4,196       | 資本市場                 |
| EVRAZ PLC                    | 28               | 63           | 20           | 2,896       | 金属・鉱業                |
| SAGE GROUP PLC (THE)         | 40               | 47           | 34           | 4,771       | ソフトウェア               |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 4                | 4            | 10           | 1,421       | 飲料                   |
| COMPASS GROUP PLC            | 26               | 26           | 33           | 4,643       | ホテル・レストラン・レジャー       |
| VODAFONE GROUP PLC           | 82               | 82           | 9            | 1,250       | 無線通信サービス             |
| FERGUSON PLC                 | 4                | 5            | 37           | 5,204       | 商社・流通業               |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 120              | 108          | 60           | 8,291       | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 27               | 82           | 24           | 3,342       | 保険                   |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 593<br>19    | 660<br>20    | 502<br>—    | 69,302<br><3.8%>     |
| (スイス)                        |                  |              | 千スイスフラン      |             |                      |
| SGS SA-REG                   | 0.29             | 0.43         | 103          | 12,070      | 専門サービス               |
| NOVARTIS AG-REG              | —                | 5            | 40           | 4,771       | 医薬品                  |
| ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 4                | 4            | 156          | 18,285      | 医薬品                  |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 0.48             | 1            | 9            | 1,075       | 専門サービス               |
| NESTLE SA-REG                | 5                | 8            | 89           | 10,444      | 食品                   |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | —                | 0.55         | 11           | 1,349       | ヘルスケア機器・用品           |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 0.27             | 0.26         | 23           | 2,682       | ヘルスケア機器・用品           |
| THE SWATCH GROUP AG-B        | 0.54             | 0.74         | 15           | 1,754       | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| THE SWATCH GROUP AG-REG      | 0.36             | 0.36         | 1            | 163         | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 0.5              | 0.6          | 53           | 6,175       | 資本市場                 |

| 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       |             |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG |              | 7     | 7    | 126         | 14,772   | 海運業         |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG |              | —     | 2    | 16          | 1,904    | コンピュータ・周辺機器 |
| 小 計                        | 株 数 ・ 金 額    | 20    | 32   | 647         | 75,450   |             |
|                            | 銘柄 数 < 比 率 > | 9     | 12   | —           | < 4.1% > |             |
| (スウェーデン)                   |              |       |      | 千スウェーデンクローナ |          |             |
| SWEDISH MATCH AB           |              | 7     | 9    | 675         | 8,196    | タバコ         |
| HENNES&MAURITZ AB-B        |              | 30    | 31   | 443         | 5,389    | 専門小売り       |
| ERICSSON LM-B              |              | 57    | 61   | 597         | 7,257    | 通信機器        |
| HUSQVARNA AB-B SHS         |              | 17    | 4    | 38          | 461      | 家庭用耐久財      |
| SANDVIK AB                 |              | 9     | 13   | 246         | 2,986    | 機械          |
| ATLAS COPCO AB-A           |              | 3     | 8    | 357         | 4,334    | 機械          |
| ATLAS COPCO AB-B           |              | —     | 4    | 150         | 1,825    | 機械          |
| 小 計                        | 株 数 ・ 金 額    | 125   | 132  | 2,508       | 30,450   |             |
|                            | 銘柄 数 < 比 率 > | 6     | 7    | —           | < 1.7% > |             |
| (ノルウェー)                    |              |       |      | 千ノルウェークローネ  |          |             |
| TELENOR ASA                |              | —     | 12   | 186         | 2,203    | 各種電気通信サービス  |
| ORKLA ASA                  |              | 21    | 27   | 251         | 2,961    | 食品          |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA  |              | —     | 3    | 66          | 785      | 保険          |
| SCHIBSTED ASA-B SHS        |              | 4     | 4    | 157         | 1,854    | メディア        |
| 小 計                        | 株 数 ・ 金 額    | 26    | 47   | 661         | 7,804    |             |
|                            | 銘柄 数 < 比 率 > | 2     | 4    | —           | < 0.4% > |             |
| (デンマーク)                    |              |       |      | 千デンマーククローネ  |          |             |
| CARLSBERG B                |              | 1     | 1    | 152         | 2,572    | 飲料          |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B     |              | 0.26  | 0.28 | 278         | 4,688    | 海運業         |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A  |              | 0.23  | 0.24 | 220         | 3,724    | 海運業         |
| H LUNDBECK A/S             |              | 4     | 5    | 118         | 2,002    | 医薬品         |
| PANDORA A/S                |              | 4     | 4    | 205         | 3,465    | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES     |              | —     | 1    | 43          | 738      | 化学          |
| COLOPLAST-B                |              | 8     | 6    | 613         | 10,346   | ヘルスケア機器・用品  |
| NOVO NORDISK A/S-B         |              | 26    | 22   | 953         | 16,069   | 医薬品         |
| ISS A/S                    |              | 7     | —    | —           | —        | 商業サービス・用品   |
| TRYG A/S                   |              | 4     | 4    | 90          | 1,524    | 保険          |
| 小 計                        | 株 数 ・ 金 額    | 56    | 46   | 2,676       | 45,133   |             |
|                            | 銘柄 数 < 比 率 > | 9     | 9    | —           | < 2.5% > |             |
| (ユーロ…ドイツ)                  |              |       |      | 千ユーロ        |          |             |
| ADIDAS AG                  |              | 3     | 2    | 74          | 9,337    | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GEA GROUP AG               |              | 3     | 3    | 10          | 1,364    | 機械          |
| DEUTSCHE POST AG-REG       |              | 31    | 25   | 98          | 12,290   | 航空貨物・物流サービス |
| PUMA SE                    |              | 2     | 3    | 22          | 2,776    | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BEIERSDORF AG              |              | 3     | 4    | 41          | 5,178    | パーソナル用品     |
| HOCHTIEF AG                |              | 1     | 1    | 7           | 1,001    | 建設・土木       |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG     |              | —     | 7    | 6           | 772      | 旅客航空輸送業     |
| DEUTSCHE BOERSE AG         |              | 4     | 5    | 76          | 9,638    | 資本市場        |
| HUGO BOSS AG               |              | 10    | —    | —           | —        | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG    |              | —     | 3    | 15          | 1,897    | ヘルスケア機器・用品  |
| METRO AG                   |              | 28    | 34   | 29          | 3,659    | 食品・生活必需品小売り |
| INNOGY SE-NEW              |              | 2     | —    | —           | —        | 総合公益事業      |
| COVESTRO AG                |              | 10    | 11   | 50          | 6,348    | 化学          |
| 小 計                        | 株 数 ・ 金 額    | 101   | 101  | 432         | 54,264   |             |
|                            | 銘柄 数 < 比 率 > | 11    | 11   | —           | < 3.0% > |             |
| (ユーロ…イタリア)                 |              |       |      |             |          |             |
| ENI SPA                    |              | 16    | 33   | 25          | 3,221    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| TELECOM ITALIA SPA         |              | 276   | 378  | 14          | 1,834    | 各種電気通信サービス  |
| TELECOM ITALIA-RNC         |              | 133   | 133  | 5           | 645      | 各種電気通信サービス  |
| PRYSMIAN SPA               |              | 9     | 0.91 | 2           | 269      | 電気設備        |

| 銘柄                                  | 株数      | 当期   |      | 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…イタリア)                          | 百株      | 百株   |      | 千円    |        |             |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA         | 11      | 16   | 20   | 2,622 |        | 銀行          |
| 小計                                  | 株数・金額   | 446  | 562  | 68    | 8,594  |             |
|                                     | 銘柄数<比率> | 5    | 5    | —     | <0.5%> |             |
| (ユーロ…フランス)                          |         |      |      |       |        |             |
| LOREAL-ORD                          | 2       | 2    | 75   | 9,497 |        | パーソナル用品     |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 0.45    | 0.3  | 12   | 1,520 |        | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VIVENDI SA                          | 7       | 2    | 5    | 649   |        | 娯楽          |
| ORANGE SA                           | 17      | 5    | 5    | 655   |        | 各種電気通信サービス  |
| SOCIETE BIC SA                      | 0.87    | —    | —    | —     |        | 商業サービス・用品   |
| KERING SA                           | 0.23    | 0.77 | 42   | 5,335 |        | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CARREFOUR SUPERMARCHE               | 11      | 11   | 17   | 2,167 |        | 食品・生活必需品小売り |
| ATOS SE                             | 2       | —    | —    | —     |        | 情報技術サービス    |
| STMICROELECTRONICS NV               | 14      | —    | —    | —     |        | 半導体・半導体製造装置 |
| PEUGEOT CITROEN                     | 10      | 1    | 2    | 316   |        | 自動車         |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)          | 3       | 1    | 6    | 787   |        | 建設関連製品      |
| IPSEN                               | 0.55    | 0.55 | 4    | 621   |        | 医薬品         |
| ARKEMA                              | —       | 0.79 | 7    | 941   |        | 化学          |
| 小計                                  | 株数・金額   | 72   | 27   | 179   | 22,492 |             |
|                                     | 銘柄数<比率> | 12   | 10   | —     | <1.2%> |             |
| (ユーロ…オランダ)                          |         |      |      |       |        |             |
| RANDSTAD NV                         | 3       | 4    | 20   | 2,517 |        | 専門サービス      |
| KONINKLIJKE KPN NV                  | 16      | 117  | 26   | 3,263 |        | 各種電気通信サービス  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV              | 14      | 15   | 63   | 8,015 |        | ヘルスケア機器・用品  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV       | 13      | 14   | 36   | 4,522 |        | 食品・生活必需品小売り |
| AKZO NOBEL                          | 6       | 2    | 24   | 3,028 |        | 化学          |
| ING GROEP NV                        | 42      | 15   | 10   | 1,336 |        | 銀行          |
| 小計                                  | 株数・金額   | 96   | 169  | 180   | 22,684 |             |
|                                     | 銘柄数<比率> | 6    | 6    | —     | <1.2%> |             |
| (ユーロ…スペイン)                          |         |      |      |       |        |             |
| AMADEUS IT GROUP SA                 | 0.38    | —    | —    | —     |        | 情報技術サービス    |
| AENA SME SA                         | —       | 0.37 | 4    | 575   |        | 運送インフラ      |
| 小計                                  | 株数・金額   | 0.38 | 0.37 | 4     | 575    |             |
|                                     | 銘柄数<比率> | 1    | 1    | —     | <0.0%> |             |
| (ユーロ…ベルギー)                          |         |      |      |       |        |             |
| UCB SA                              | —       | 1    | 16   | 2,054 |        | 医薬品         |
| COLRUYT SA                          | 3       | 4    | 24   | 3,133 |        | 食品・生活必需品小売り |
| PROXIMUS                            | 5       | 6    | 11   | 1,466 |        | 各種電気通信サービス  |
| 小計                                  | 株数・金額   | 8    | 13   | 53    | 6,654  |             |
|                                     | 銘柄数<比率> | 2    | 3    | —     | <0.4%> |             |
| (ユーロ…オーストリア)                        |         |      |      |       |        |             |
| ANDRITZ AG                          | —       | 1    | 3    | 489   |        | 機械          |
| 小計                                  | 株数・金額   | —    | 1    | 3     | 489    |             |
|                                     | 銘柄数<比率> | —    | 1    | —     | <0.0%> |             |
| (ユーロ…フィンランド)                        |         |      |      |       |        |             |
| STORA ENSO OYJ-R                    | 5       | —    | —    | —     |        | 紙製品・林産品     |
| METSO OYJ                           | 2       | —    | —    | —     |        | 機械          |
| NOKIA OYJ                           | 24      | 24   | 8    | 1,111 |        | 通信機器        |
| NOKIAN RENKAAT OYJ                  | 0.98    | —    | —    | —     |        | 自動車部品       |
| ORION OYJ                           | 6       | 8    | 33   | 4,212 |        | 医薬品         |
| 小計                                  | 株数・金額   | 40   | 33   | 42    | 5,323  |             |
|                                     | 銘柄数<比率> | 5    | 2    | —     | <0.3%> |             |

| 銘柄                                   | 株数               | 株数           | 期末           |          | 業種等                  |
|--------------------------------------|------------------|--------------|--------------|----------|----------------------|
|                                      |                  |              | 評価額          |          |                      |
|                                      |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額   |                      |
| (ユーロ…アイランド)                          | 百株               | 百株           | 千ユーロ         | 千円       |                      |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC            | 1                | 2            | 33           | 4,234    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1<br>1       | 2<br>33      | 4,234    |                      |
| ユーロ計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 767<br>43    | 913<br>40    | 999<br>- | 125,312<br><6.9%>    |
| (香港)                                 |                  |              | 千香港ドル        |          |                      |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY               | 13               | 18           | 142          | 1,948    | 半導体・半導体製造装置          |
| PCCW LTD                             | 120              | 210          | 96           | 1,324    | 各種電気通信サービス           |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG             | 45               | -            | -            | -        | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| SJM HOLDINGS LIMITED                 | 130              | 130          | 130          | 1,792    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| WYNN MACAU LTD                       | 64               | 64           | 87           | 1,203    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| HKT TRUST AND HKT LTD                | 120              | 160          | 171          | 2,351    | 各種電気通信サービス           |
| SANDS CHINA LTD                      | 48               | 60           | 195          | 2,685    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| PACIFIC CENTURY PREMIUM DEVE         | -                | 22           | 4            | 59       | 不動産管理・開発             |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 540<br>7     | 664<br>7     | 829<br>- | 11,365<br><0.6%>     |
| (シンガポール)                             |                  |              | 千シンガポールドル    |          |                      |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 31               | 41           | 35           | 2,739    | 資本市場                 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 185              | 239          | 53           | 4,122    | 各種電気通信サービス           |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 216<br>2     | 280<br>2     | 88<br>-  | 6,862<br><0.4%>      |
| (オーストラリア)                            |                  |              | 千豪ドル         |          |                      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           | 9                | 9            | 17           | 1,378    | 金属・鉱業                |
| TELSTRA CORP LTD                     | 173              | 185          | 53           | 4,091    | 各種電気通信サービス           |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 | 23               | 23           | 21           | 1,640    | 飲料                   |
| BHP GROUP LIMITED                    | 10               | 10           | 39           | 3,065    | 金属・鉱業                |
| CSL LIMITED                          | 3                | -            | -            | -        | バイオテクノロジー            |
| COCHLEAR LTD                         | 5                | 5            | 105          | 8,105    | ヘルスケア機器・用品           |
| BORAL LTD                            | 3                | -            | -            | -        | 建設資材                 |
| RIO TINTO LTD                        | 4                | 4            | 46           | 3,578    | 金属・鉱業                |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD       | 5                | -            | -            | -        | ホテル・レストラン・レジャー       |
| NEWCREST MINING                      | 7                | -            | -            | -        | 金属・鉱業                |
| WESFARMERS LIMITED                   | 8                | 21           | 96           | 7,428    | 複合小売り                |
| WOOLWORTHS GROUP LTD                 | 26               | 28           | 104          | 8,040    | 食品・生活必需品小売り          |
| CIMIC GROUP LTD                      | 5                | 8            | 16           | 1,239    | 建設・土木                |
| COLES GROUP LTD                      | -                | 22           | 37           | 2,868    | 食品・生活必需品小売り          |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 288<br>13    | 319<br>10    | 536<br>- | 41,437<br><2.3%>     |
| (ニュージーランド)                           |                  |              | 千ニュージーランドドル  |          |                      |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                | 75               | 75           | 35           | 2,551    | 各種電気通信サービス           |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 75<br>1      | 75<br>1      | 35<br>-  | 2,551<br><0.1%>      |
| 合計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,059<br>260 | 4,738<br>254 | -<br>-   | 1,673,709<br><91.7%> |

\* 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により邦貨換算したものです。

\* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○投資信託財産の構成

(2020年9月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 株式           | 1,812,987 | 99.3  |
| コール・ローン等、その他 | 12,447    | 0.7   |
| 投資信託財産総額     | 1,825,434 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産（1,679,538千円）の投資信託財産総額（1,825,434千円）に対する比率は92.0%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=106.22円、1カナダドル=80.70円、1英ポンド=137.97円、1スイスフラン=116.48円、1スウェーデンクローナ=12.14円、1ノルウェークローネ=11.79円、1デンマーククローネ=16.86円、1ユーロ=125.40円、1香港ドル=13.71円、1シンガポールドル=77.70円、1豪ドル=77.18円、1ニュージーランドドル=70.91円、1新シエクル=31.27円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年9月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末         |
|-----------------|---------------|
|                 | 円             |
| (A) 資産          | 1,825,434,325 |
| コール・ローン等        | 8,771,286     |
| 株式(評価額)         | 1,812,987,643 |
| 未収配当金           | 2,782,715     |
| 差入委託証拠金         | 892,681       |
| (B) 負債          | 8             |
| 未払利息            | 8             |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 1,825,434,317 |
| 元本              | 989,668,590   |
| 次期繰越損益金         | 835,765,727   |
| (D) 受益権総口数      | 989,668,590口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,445円       |

(注) 期首元本額は943,351,705円、期中追加設定元本額は524,132,772円、期中一部解約元本額は477,815,887円、1口当たり純資産額は1.8445円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額・ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式 932,372,046円・野村オルウェッジ・ファクターアロケーションファンド(非課税運用機関投資家専用) 57,296,544円

## ○損益の状況 (2019年9月11日~2020年9月10日)

| 項 目                | 当 期          |
|--------------------|--------------|
|                    | 円            |
| (A) 配当等収益          | 35,484,594   |
| 受取配当金              | 35,477,726   |
| 受取利息               | 15,972       |
| その他収益金             | 2,189        |
| 支払利息               | △ 11,293     |
| (B) 有価証券売買損益       | 210,277,671  |
| 売買益                | 357,580,055  |
| 売買損                | △147,302,384 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 7,621,763    |
| 取引益                | 18,436,234   |
| 取引損                | △ 10,814,471 |
| (D) 保管費用等          | △ 2,974,543  |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 250,409,485  |
| (F) 前期繰越損益金        | 623,045,063  |
| (G) 追加信託差損益金       | 328,484,178  |
| (H) 解約差損益金         | △366,172,999 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 835,765,727  |
| 次期繰越損益金(I)         | 835,765,727  |

\*損益の状況の中で(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えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、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をいいます。

\*損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第13期（決算日2020年5月11日）

作成対象期間（2019年5月11日～2020年5月11日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSA1指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。MSCI-KOKUSA1指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。 |
| 主な投資対象 | 外国の株式を主要投資対象とします。   |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。  |

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12- 1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |       | ベンチマーク<br>MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・為替ヘッジあり) |       | 株組入比率 | 株先物比率 | 投資信託<br>証券組入比率 | 純資産<br>総額     |
|-----------------|--------|-------|--|-------|-------|-------|----------------|---------------|
|                 | 円      | 騰落率   | 円  | 騰落率   |       |       |                |               |
| 9期(2016年5月10日)  | 13,960 | △ 5.3 | 144.29                                     | △ 5.0 | 96.4  | 1.5   | 2.8            | 百万円<br>36,074 |
| 10期(2017年5月10日) | 16,645 | 19.2  | 172.56                                     | 19.6  | 97.6  | 1.5   | 2.6            | 41,161        |
| 11期(2018年5月10日) | 18,307 | 10.0  | 190.38                                     | 10.3  | 95.7  | 2.1   | 2.3            | 42,912        |
| 12期(2019年5月10日) | 19,006 | 3.8   | 198.20                                     | 4.1   | 94.5  | 1.9   | 2.5            | 47,201        |
| 13期(2020年5月11日) | 18,768 | △ 1.3 | 196.06                                     | △ 1.1 | 94.4  | 3.8   | 2.5            | 45,766        |

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジあり)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI円ヘッジ指数(円ベース)を使用しております。  
(出所) MSCI

## ○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<br>MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・為替ヘッジあり) |       | 株組入比率 | 株先物比率 | 投資信託<br>証券組入比率 |
|--------------------|--------|-------|--|-------|-------|-------|----------------|
|                    | 円      | 騰落率   | 円  | 騰落率   |       |       |                |
| (期首)<br>2019年5月10日 | 19,006 | —     | 198.20                                     | —     | 94.5  | 1.9   | 2.5            |
| 5月末                | 18,615 | △ 2.1 | 194.13                                     | △ 2.1 | 94.0  | 1.9   | 2.6            |
| 6月末                | 19,427 | 2.2   | 202.62                                     | 2.2   | 95.7  | 1.1   | 2.6            |
| 7月末                | 19,890 | 4.7   | 207.51                                     | 4.7   | 94.3  | 2.9   | 2.6            |
| 8月末                | 19,314 | 1.6   | 201.50                                     | 1.7   | 93.0  | 2.0   | 2.8            |
| 9月末                | 19,648 | 3.4   | 205.08                                     | 3.5   | 96.3  | 2.5   | 2.8            |
| 10月末               | 20,094 | 5.7   | 209.72                                     | 5.8   | 96.8  | 1.8   | 2.8            |
| 11月末               | 20,751 | 9.2   | 216.60                                     | 9.3   | 96.0  | 2.3   | 2.7            |
| 12月末               | 21,221 | 11.7  | 221.51                                     | 11.8  | 95.7  | 2.1   | 2.7            |
| 2020年1月末           | 21,377 | 12.5  | 223.19                                     | 12.6  | 96.0  | 0.8   | 2.8            |
| 2月末                | 19,633 | 3.3   | 205.12                                     | 3.5   | 90.3  | 8.6   | 2.6            |
| 3月末                | 16,915 | △11.0 | 176.68                                     | △10.9 | 90.5  | 7.3   | 2.5            |
| 4月末                | 18,862 | △ 0.8 | 196.92                                     | △ 0.6 | 92.2  | 4.6   | 2.5            |
| (期末)<br>2020年5月11日 | 18,768 | △ 1.3 | 196.06                                     | △ 1.1 | 94.4  | 3.8   | 2.5            |

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。  
ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。  
請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測の高まりなどを巡り一進一退となりましたが、2019年10月以降は、堅調な米企業の決算や市場予想を上回る米国の経済指標の発表、米中貿易協議の進展への期待などから上昇しました。2020年2月下旬には、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まる中、下落に転じました。その後も、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に歯止めがかからず、世界景気の先行き懸念が強まったことや、OPEC（石油輸出国機構）とロシアなど非加盟産油国の減産交渉決裂を受けた原油価格の急落などを受けて、一段と下落しました。3月下旬以降は、欧米で新型コロナウイルスの感染拡大の勢いが鈍化しつつあるとの見方やFRB（米連邦準備制度理事会）の緊急資金供給策の発表などを受けて上昇に転じました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

株式（投資信託証券や先物を含む）組入比率は、期を通じて概ねベンチマーク（MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり））の株式比率と同等に維持しました。

### ・期中の主な動き

ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がベンチマークの中で占める比率にほぼ一致させ、ベンチマークの変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、資金流出入に対しても速やかに対応しました。

### ・為替ヘッジ

為替ヘッジ（為替の売り予約）を行い、外貨建て資産の実質組入比率を期を通じて概ねベンチマークの外貨比率と同等に維持しました。

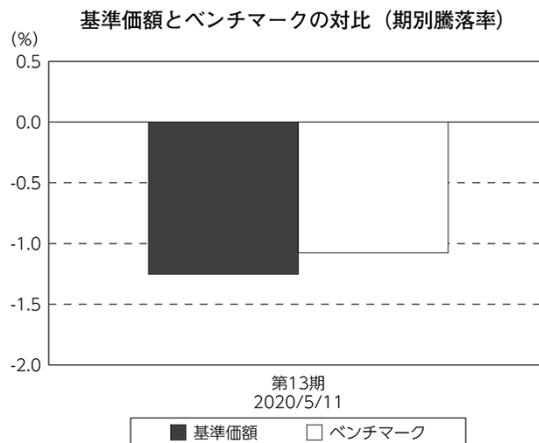
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-1.3%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の-1.1%を0.2ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月11日～2020年5月11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)                 | 1   | 0.006   |  |
| (投資信託証券)              | (1) | (0.004) |  |
| (先物・オプション)            | (0) | (0.000) |  |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2   | 0.009   | (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)                 | (2) | (0.008) |  |
| (投資信託証券)              | (0) | (0.000) |  |
| (c) そ の 他 費 用         | 3   | 0.018   | (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><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><br>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (3) | (0.016) |  |
| (そ の 他)               | (0) | (0.001) |  |
| 合 計                   | 6   | 0.033   |  |
| 期中の平均基準価額は、19,645円です。 |     |         |  |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 株式

|         |                 | 買 付                    |                                  | 売 付                   |                                  |
|---------|-----------------|------------------------|----------------------------------|-----------------------|----------------------------------|
|         |                 | 株 数                    | 金 額                              | 株 数                   | 金 額                              |
| 外       | アメリカ            | 百株<br>6,190<br>( 882)  | 千米ドル<br>54,479<br>( 4,077)       | 百株<br>5,685<br>( 782) | 千米ドル<br>48,330<br>( 5,306)       |
|         | カナダ             | 744<br>( 52)           | 千カナダドル<br>4,377<br>( 102)        | 705<br>( 105)         | 千カナダドル<br>3,261<br>( 331)        |
|         | イギリス            | 4,496<br>(9,128)       | 千英ポンド<br>3,817<br>( 49)          | 3,904<br>(22,326)     | 千英ポンド<br>3,215<br>( 26)          |
|         | スイス             | 286<br>( -)            | 千スイスフラン<br>2,633<br>(△ 26)       | 268                   | 千スイスフラン<br>2,415                 |
|         | スウェーデン          | 559<br>( 146)          | 千スウェーデンクローナ<br>7,447<br>( 1,501) | 566<br>( 60)          | 千スウェーデンクローナ<br>6,549<br>( 1,501) |
|         | ノルウェー           | 98                     | 千ノルウェークローネ<br>1,637              | 120                   | 千ノルウェークローネ<br>1,890              |
|         | デンマーク           | 87                     | 千デンマーククローネ<br>4,044              | 81                    | 千デンマーククローネ<br>3,577              |
|         | ユーロ             |                        | 千ユーロ                             |                       | 千ユーロ                             |
|         | ドイツ             | 452<br>( 27)           | 2,347<br>(△ 2)                   | 408<br>( 20)          | 2,019<br>( 40)                   |
|         | イタリア            | 1,301                  | 645                              | 1,146                 | 534                              |
|         | フランス            | 531<br>( 5)            | 2,877<br>(△ 1)                   | 514                   | 2,547                            |
|         | オランダ            | 305                    | 1,373                            | 159                   | 773                              |
|         | スペイン            | 1,264<br>(1,920)       | 822<br>( 71)                     | 1,075<br>( 1,858)     | 684<br>( 50)                     |
|         | ベルギー            | 42                     | 327                              | 35                    | 197                              |
| オーストリア  | 4<br>( -)       | 11<br>(△ 4)            | 6                                | 22                    |                                  |
| ルクセンブルグ | -               | -                      | 3                                | 13                    |                                  |
| フィンランド  | 65<br>( 5)      | 243<br>( -)            | 58                               | 189                   |                                  |
| アイルランド  | 33<br>( 0.14)   | 158<br>( -)            | 41                               | 179                   |                                  |
| ポルトガル   | 9               | 14                     | 6                                | 8                     |                                  |
| 香港      | 1,449<br>( 112) | 千香港ドル<br>7,986<br>( -) | 1,742                            | 千香港ドル<br>7,214        |                                  |

|   |          | 買 付                 |                           | 売 付           |                         |
|---|----------|---------------------|---------------------------|---------------|-------------------------|
|   |          | 株 数                 | 金 額                       | 株 数           | 金 額                     |
| 外 | シンガポール   | 百株<br>440<br>( 356) | 千シンガポールドル<br>429<br>( 36) | 百株<br>1,339   | 千シンガポールドル<br>403        |
|   | オーストラリア  | 1,052<br>( 176)     | 千豪ドル<br>3,107<br>( 192)   | 773<br>( 155) | 千豪ドル<br>2,424<br>( 186) |
| 国 | ニュージーランド | 256                 | 千ニュージーランドドル<br>133        | 140           | 千ニュージーランドドル<br>86       |
|   | イスラエル    | 140<br>( 6)         | 千新シエケル<br>194<br>( ー)     | 256           | 千新シエケル<br>67            |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 投資信託証券

| 銘 柄                                  | 買 付               |               | 売 付   |        |
|--------------------------------------|-------------------|---------------|-------|--------|
|                                      | 口 数               | 金 額           | 口 数   | 金 額    |
| アメリカ                                 | 口                 | 千米ドル          | 口     | 千米ドル   |
| AMERICAN TOWER CORP                  | 1,030             | 224           | 710   | 147    |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | —                 | —             | 2,669 | 52     |
| CROWN CASTLE INTL CORP               | 930               | 133           | 940   | 129    |
| DIGITAL REALTY TRUST INC             | 700               | 95            | —     | —      |
| EQUINIX INC                          | 110               | 52            | —     | —      |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES          | 1,190<br>( 1,190) | 149<br>( —)   | 780   | 56     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC             | 180               | 58            | 170   | 55     |
| HCP INC                              | —<br>(△ 6,100)    | —<br>(△ 183)  | —     | —      |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC            | —<br>( 6,100)     | —<br>( 183)   | —     | —      |
| INVITATION HOMES INC                 | 2,400             | 62            | —     | —      |
| LIBERTY PROPERTY TRUST               | —<br>(△ 1,400)    | —<br>(△ 67)   | —     | —      |
| MACERICH CO /THE                     | —                 | —             | 800   | 21     |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC         | 4,800             | 99            | —     | —      |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS           | 2,000             | 84            | —     | —      |
| PROLOGIS INC                         | 2,455<br>( 945)   | 197<br>( 67)  | 1,600 | 117    |
| PUBLIC STORAGE                       | 730               | 156           | 530   | 104    |
| REALTY INCOME CORP                   | 1,500             | 111           | 700   | 53     |
| REGENCY CENTERS CORP                 | 900               | 59            | —     | —      |
| SUN COMMUNITIES INC                  | 1,210             | 161           | —     | —      |
| VICI PROPERTIES INC                  | 4,400             | 108           | —     | —      |
| WELLTOWER INC                        | 1,560             | 127           | 690   | 58     |
| 小 計                                  | 26,095<br>( 735)  | 1,884<br>( —) | 9,589 | 797    |
| カナダ                                  |                   | 千カナダドル        |       | 千カナダドル |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA         | 400               | 21            | —     | —      |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | —<br>( 1,100)     | —<br>( 23)    | —     | —      |
| 小 計                                  | 400<br>( 1,100)   | 21<br>( 23)   | —     | —      |
| イギリス                                 |                   | 千英ポンド         |       | 千英ポンド  |
| HAMMERSON PLC                        | —                 | —             | 8,600 | 23     |
| SEGRO PLC                            | 5,340             | 37            | —     | —      |
| 小 計                                  | 5,340             | 37            | 8,600 | 23     |
| ユーロ                                  |                   | 千ユーロ          |       | 千ユーロ   |
| フランス                                 |                   |               |       |        |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD            | 350               | 41            | 330   | 44     |
| 小 計                                  | 350               | 41            | 330   | 44     |
| ユ ー ロ 計                              | 350               | 41            | 330   | 44     |

| 銘 柄    |                              | 買 付                 |                  | 売 付                |            |
|--------|------------------------------|---------------------|------------------|--------------------|------------|
|        |                              | 口 数                 | 金 額              | 口 数                | 金 額        |
| 外<br>国 | 香港                           |                     | 千香港ドル            |                    | 千香港ドル      |
|        | LINK REIT                    | 10,500              | 792              | 8,000              | 576        |
|        | 小 計                          | 10,500              | 792              | 8,000              | 576        |
|        | シンガポール                       |                     | 千シンガポールドル        |                    | 千シンガポールドル  |
|        | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 17,600<br>( 5,440)  | 53<br>( 15)      | 17,000             | 53         |
|        | ASCENDAS REAL ESTATE-RTS     | —<br>( 5,440)       | —<br>( 14)       | —<br>( 5,440)      | —<br>( 1)  |
|        | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 15,800              | 32               | —                  | —          |
|        | SUNTEC REIT                  | —<br>( —)           | —<br>(△0.20155)  | —                  | —          |
|        | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 24,000<br>( —)      | 58<br>(△ 0.0072) | —                  | —          |
|        | 小 計                          | 57,400<br>( 10,880) | 145<br>( 29)     | 17,000<br>( 5,440) | 53<br>( 1) |
|        | オーストラリア                      |                     | 千豪ドル             |                    | 千豪ドル       |
|        | MIRVAC GROUP                 | 18,000              | 57               | 18,000             | 61         |
|        | GOODMAN GROUP                | 4,400               | 60               | 3,500              | 47         |
|        | SCENTRE GROUP                | —                   | —                | 16,000             | 61         |
|        | 小 計                          | 22,400              | 117              | 37,500             | 170        |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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<br>国 | 株式先物取引 | 百万円<br>22,199 | 百万円<br>21,057 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*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

(2019年5月11日～2020年5月11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       | 16,228,956千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 46,041,693千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.35         |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A          |               |          | 売付額等<br>C          |               |        |
|--------|--------------------|---------------|----------|--------------------|---------------|--------|
|        | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ |          | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |        |
| 為替先物取引 | 百万円<br>574,845     | 百万円<br>484    | %<br>0.1 | 百万円<br>574,167     | 百万円<br>—      | %<br>— |
| 為替直物取引 | 8,496              | —             | —        | 7,679              | 484           | 6.3    |

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野村信託銀行です。

(2020年5月11日現在)

## ○組入資産の明細

## 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                    | 82      | 80  | 290    | 31,024    | 保険                      |
| AES CORP                     | 93      | 79  | 101    | 10,873    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AT & T INC                   | 826     | 852 | 2,538  | 271,450   | 各種電気通信サービス              |
| ABBOTT LABORATORIES          | 196     | 207 | 1,939  | 207,439   | ヘルスケア機器・用品              |
| ABBVIE INC                   | 168     | 173 | 1,456  | 155,794   | バイオテクノロジー               |
| ABIOMED INC                  | 5       | 5   | 93     | 10,003    | ヘルスケア機器・用品              |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 86      | 84  | 614    | 65,707    | 娯楽                      |
| ACUITY BRANDS INC            | 4       | 4   | 37     | 4,046     | 電気設備                    |
| ADOBE INC                    | 54      | 56  | 2,080  | 222,467   | ソフトウェア                  |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 7       | 7   | 94     | 10,148    | 専門小売り                   |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 109     | 126 | 670    | 71,677    | 半導体・半導体製造装置             |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 6       | —   | —      | —         | 資本市場                    |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 35      | 35  | 286    | 30,604    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AIR PRODUCTS                 | 24      | 26  | 614    | 65,672    | 化学                      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          | 18      | 18  | 182    | 19,472    | 情報技術サービス                |
| ALBEMARLE CORP               | 10      | 10  | 69     | 7,421     | 化学                      |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 25      | 25  | 244    | 26,130    | バイオテクノロジー               |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 8       | 8   | 170    | 18,194    | ヘルスケア機器・用品              |
| ALLEGHANY CORP               | 1       | 1   | 90     | 9,645     | 保険                      |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 5       | 5   | 24     | 2,573     | 情報技術サービス                |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 33      | 24  | 115    | 12,318    | 電力                      |
| ALLSTATE CORP                | 42      | 37  | 375    | 40,207    | 保険                      |
| ALLY FINANCIAL INC           | 40      | 40  | 63     | 6,750     | 消費者金融                   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 8       | 10  | 148    | 15,869    | バイオテクノロジー               |
| ALPHABET INC-CL C            | 35      | 35  | 4,996  | 534,401   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALPHABET INC-CL A            | 34      | 34  | 4,828  | 516,416   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALTICE USA INC-A             | 29      | 12  | 28     | 3,003     | メディア                    |
| ALTRIA GROUP INC             | 218     | 214 | 786    | 84,087    | タバコ                     |
| AMAZON.COM INC               | 46      | 48  | 11,631 | 1,243,992 | インターネット販売・通信販売          |
| AMERCO                       | 0.8     | 0.8 | 24     | 2,577     | 陸運・鉄道                   |
| AMEREN CORPORATION           | 30      | 30  | 212    | 22,735    | 総合公益事業                  |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 11      | 11  | 11     | 1,192     | 旅客航空輸送業                 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 54      | 53  | 428    | 45,865    | 電力                      |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 81      | 81  | 729    | 78,012    | 消費者金融                   |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 11      | 11  | 74     | 7,944     | 保険                      |
| AMERICAN INTL GROUP          | 101     | 101 | 279    | 29,867    | 保険                      |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 21      | 21  | 257    | 27,518    | 水道                      |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 16      | 16  | 145    | 15,545    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 16      | 15  | 192    | 20,554    | 資本市場                    |
| AMETEK INC                   | 26      | 26  | 221    | 23,717    | 電気設備                    |
| AMGEN INC                    | 71      | 69  | 1,634  | 174,793   | バイオテクノロジー               |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 36      | 37  | 334    | 35,823    | 電子装置・機器・部品              |
| ANADARKO PETE                | 61      | —   | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |

| 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        |                         |
| ANALOG DEVICES INC                 | 40      | 41  | 454    | 48,629    | 半導体・半導体製造装置             |
| ANSYS INC                          | 9       | 9   | 249    | 26,723    | ソフトウェア                  |
| ANTHEM INC                         | 29      | 29  | 814    | 87,138    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APACHE CORPORATION                 | 44      | 44  | 54     | 5,858     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| APPLE INC                          | 536     | 515 | 15,993 | 1,710,494 | コンピュータ・周辺機器             |
| APPLIED MATERIALS                  | 115     | 110 | 591    | 63,304    | 半導体・半導体製造装置             |
| ARAMARK                            | 30      | 30  | 78     | 8,367     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARCHER DANIELS MIDLAND             | 63      | 63  | 229    | 24,519    | 食品                      |
| ARCONIC INC                        | 44      | —   | —      | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| ARISTA NETWORKS INC                | 5       | 5   | 122    | 13,057    | 通信機器                    |
| ARROW ELECTRS INC                  | 7       | 7   | 49     | 5,250     | 電子装置・機器・部品              |
| ASSURANT INC                       | 7       | 7   | 74     | 7,924     | 保険                      |
| ATMOS ENERGY CORP                  | 11      | 11  | 113    | 12,179    | ガス                      |
| AUTODESK INC.                      | 24      | 24  | 457    | 48,880    | ソフトウェア                  |
| AUTOLIV INC                        | 9       | 9   | 59     | 6,408     | 自動車部品                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESS             | 48      | 51  | 748    | 80,103    | 情報技術サービス                |
| AUTOZONE                           | 2       | 2   | 279    | 29,869    | 専門小売り                   |
| AVERY DENNISON CORP                | 8       | 8   | 88     | 9,465     | 容器・包装                   |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC         | 19      | —   | —      | —         | 各種金融サービス                |
| BB&T CORPORATION                   | 93      | —   | —      | —         | 銀行                      |
| BAKER HUGHES CO                    | 52      | 65  | 97     | 10,434    | エネルギー設備・サービス            |
| BALL CORP                          | 33      | 33  | 213    | 22,785    | 容器・包装                   |
| BANK OF AMERICA CORP               | 1,060   | 998 | 2,352  | 251,576   | 銀行                      |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP        | 109     | 97  | 342    | 36,662    | 資本市場                    |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.          | 61      | 52  | 464    | 49,644    | ヘルスケア機器・用品              |
| BECTON, DICKINSON                  | 29      | 32  | 814    | 87,093    | ヘルスケア機器・用品              |
| BEIGENE, LTD ADR                   | 3       | 4   | 75     | 8,049     | バイオテクノロジー               |
| WR BERKLEY CORP                    | 14      | 14  | 76     | 8,215     | 保険                      |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B        | 147     | 153 | 2,710  | 289,920   | 各種金融サービス                |
| BEST BUY COMPANY INC               | 27      | 27  | 212    | 22,705    | 専門小売り                   |
| BIO-RAD LABORATORIES-A             | —       | 2   | 91     | 9,761     | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        | 21      | 21  | 203    | 21,788    | バイオテクノロジー               |
| BIOGEN INC                         | 22      | 20  | 643    | 68,848    | バイオテクノロジー               |
| BLACK KNIGHT INC                   | —       | 14  | 101    | 10,885    | 情報技術サービス                |
| BLACKROCK INC                      | 13      | 13  | 678    | 72,548    | 資本市場                    |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A         | —       | 73  | 385    | 41,277    | 資本市場                    |
| H & R BLOCK INC                    | 18      | —   | —      | —         | 各種消費者サービス               |
| BOEING CO                          | 61      | 63  | 840    | 89,909    | 航空宇宙・防衛                 |
| BOOKING HOLDINGS INC               | 5       | 4   | 682    | 72,994    | インターネット販売・通信販売          |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS       | —       | 13  | 94     | 10,146    | 情報技術サービス                |
| BORGWARNER INC                     | 26      | 26  | 76     | 8,172     | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP             | 153     | 166 | 633    | 67,783    | ヘルスケア機器・用品              |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC          | 8       | —   | —      | —         | 保険                      |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO            | 188     | 275 | 1,678  | 179,555   | 医薬品                     |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 14      | 14  | 164    | 17,614    | 情報技術サービス                |
| BROADCOM INC                       | 46      | 46  | 1,281  | 137,071   | 半導体・半導体製造装置             |
| BROWN & BROWN INC                  | —       | 22  | 82     | 8,846     | 保険                      |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B             | 30      | 38  | 250    | 26,810    | 飲料                      |

| 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      |                         |
| BURLINGTON STORES INC         | 9       | 6   | 119   | 12,831  | 専門小売り                   |
| CBS CORP-CL B                 | 37      | —   | —     | —       | メディア                    |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC       | 12      | 12  | 124   | 13,285  | 資本市場                    |
| CBRE GROUP INC                | 40      | 40  | 166   | 17,796  | 不動産管理・開発                |
| CDK GLOBAL INC                | 14      | 14  | 58    | 6,236   | ソフトウェア                  |
| CDW CORPORATION               | 15      | 15  | 162   | 17,412  | 電子装置・機器・部品              |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC    | 24      | 24  | 69    | 7,451   | 化学                      |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 15      | 15  | 116   | 12,470  | 航空貨物・物流サービス             |
| CIGNA CORP                    | 43      | 43  | 819   | 87,649  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CIT GROUP INC                 | 10      | —   | —     | —       | 銀行                      |
| CME GROUP INC                 | 39      | 41  | 755   | 80,764  | 資本市場                    |
| CMS ENERGY CORP               | 38      | 30  | 165   | 17,739  | 総合公益事業                  |
| CSX CORP                      | 89      | 88  | 581   | 62,220  | 陸運・鉄道                   |
| CVS HEALTH CORP               | 149     | 149 | 940   | 100,585 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CABOT OIL & GAS CORP          | 46      | 46  | 94    | 10,090  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CADENCE DESIGN SYS INC        | 29      | 29  | 239   | 25,575  | ソフトウェア                  |
| CAMPBELL SOUP CO              | 20      | 20  | 102   | 10,964  | 食品                      |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 52      | 52  | 327   | 35,057  | 消費者金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC           | 35      | 35  | 174   | 18,671  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARMAX INC                    | 17      | 17  | 130   | 13,943  | 専門小売り                   |
| CARNIVAL CORP                 | 48      | 48  | 68    | 7,294   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CARRIER GLOBAL CORP           | —       | 96  | 177   | 18,968  | 建設関連製品                  |
| CATERPILLAR INC DEL           | 65      | 65  | 733   | 78,415  | 機械                      |
| CELANESE CORP-SERIES A        | 14      | 14  | 122   | 13,093  | 化学                      |
| CELGENE CORP                  | 77      | —   | —     | —       | バイオテクノロジー               |
| CENTENE CORP                  | 44      | 63  | 415   | 44,388  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC        | 61      | 61  | 113   | 12,128  | 総合公益事業                  |
| CENTURYLINK INC               | 112     | 112 | 111   | 11,906  | 各種電気通信サービス              |
| CERNER CORP                   | 31      | 33  | 226   | 24,264  | ヘルスケア・テクノロジー            |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 17      | 17  | 917   | 98,094  | メディア                    |
| CHEMOURS CO/THE               | 17      | —   | —     | —       | 化学                      |
| CHENIERE ENERGY INC           | 25      | 25  | 111   | 11,898  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHEVRON CORP                  | 216     | 221 | 2,109 | 225,652 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC    | 2       | 2   | 249   | 26,734  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CHURCH & DWIGHT CO INC        | 26      | 25  | 187   | 20,082  | 家庭用品                    |
| CIMAREX ENERGY CO             | 9       | —   | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 15      | 15  | 84    | 9,059   | 保険                      |
| CISCO SYSTEMS                 | 510     | 496 | 2,132 | 228,049 | 通信機器                    |
| CINTAS CORP                   | 9       | 9   | 209   | 22,404  | 商業サービス・用品               |
| CITIGROUP                     | 276     | 257 | 1,190 | 127,315 | 銀行                      |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP      | 53      | 53  | 117   | 12,583  | 銀行                      |
| CITRIX SYSTEMS INC            | 15      | 15  | 240   | 25,674  | ソフトウェア                  |
| CLOROX CO                     | 16      | 13  | 273   | 29,243  | 家庭用品                    |
| COCA COLA CO                  | 458     | 475 | 2,190 | 234,244 | 飲料                      |
| COGNEX CORP                   | 16      | 16  | 94    | 10,088  | 電子装置・機器・部品              |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 70      | 60  | 342   | 36,679  | 情報技術サービス                |
| COLGATE PALMOLIVE CO.         | 90      | 97  | 672   | 71,965  | 家庭用品                    |
| COMCAST CORP-CL A             | 514     | 531 | 1,940 | 207,483 | メディア                    |

| 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      |                         |
| COMERICA INC                 | 18      | 18  | 61    | 6,524   | 銀行                      |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC     | 16      | —   | —     | —       | 通信機器                    |
| CONAGRA BRANDS INC           | 61      | 61  | 204   | 21,868  | 食品                      |
| CONCHO RESOURCES INC         | 23      | 23  | 137   | 14,675  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONOCOPHILLIPS               | 129     | 123 | 529   | 56,671  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 38      | 38  | 281   | 30,147  | 総合公益事業                  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 19      | 19  | 317   | 33,921  | 飲料                      |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 11      | 11  | 17    | 1,904   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| THE COOPER COMPANIES, INC.   | 6       | 6   | 188   | 20,192  | ヘルスケア機器・用品              |
| COPART INC                   | 26      | 26  | 217   | 23,299  | 商業サービス・用品               |
| CORNING INC                  | 101     | 83  | 179   | 19,191  | 電子装置・機器・部品              |
| CORTEVA INC                  | —       | 82  | 214   | 22,967  | 化学                      |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 50      | 51  | 1,584 | 169,491 | 食品・生活必需品小売り             |
| COSTAR GROUP INC             | 3       | 3   | 256   | 27,421  | 専門サービス                  |
| COTY INC-CL A                | 43      | 43  | 22    | 2,391   | パーソナル用品                 |
| CROWN HOLDINGS INC           | 18      | 18  | 113   | 12,141  | 容器・包装                   |
| CUMMINS INC                  | 17      | 17  | 283   | 30,359  | 機械                      |
| DR HORTON INC                | 43      | 43  | 213   | 22,805  | 家庭用耐久財                  |
| DTE ENERGY COMPANY           | 22      | 22  | 227   | 24,366  | 総合公益事業                  |
| DXC TECHNOLOGY CO            | 33      | 33  | 58    | 6,248   | 情報技術サービス                |
| DANAHER CORP                 | 73      | 73  | 1,189 | 127,242 | ヘルスケア機器・用品              |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 13      | 13  | 103   | 11,107  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DAVITA INC                   | 14      | 14  | 113   | 12,092  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY              | 33      | 34  | 465   | 49,817  | 機械                      |
| DELL TECHNOLOGIES-C          | 22      | 22  | 96    | 10,270  | コンピュータ・周辺機器             |
| DELTA AIR LINES INC          | 17      | 17  | 38    | 4,130   | 旅客航空輸送業                 |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 24      | 24  | 98    | 10,520  | ヘルスケア機器・用品              |
| DEVON ENERGY CORP            | 60      | 37  | 46    | 5,025   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DEXCOM INC                   | 8       | 11  | 470   | 50,307  | ヘルスケア機器・用品              |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | 18      | 18  | 75    | 8,100   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DISNEY (WALT) CO             | 202     | 210 | 2,298 | 245,868 | 娯楽                      |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 36      | 36  | 153   | 16,448  | 消費者金融                   |
| DISCOVERY INC - A            | 20      | 20  | 42    | 4,577   | メディア                    |
| DISCOVERY INC - C            | 27      | 50  | 96    | 10,347  | メディア                    |
| DISH NETWORK CORP-A          | 24      | 24  | 61    | 6,604   | メディア                    |
| DOCUSIGN INC                 | —       | 9   | 104   | 11,219  | ソフトウェア                  |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 30      | 30  | 539   | 57,716  | 複合小売り                   |
| DOLLAR TREE INC              | 25      | 26  | 202   | 21,703  | 複合小売り                   |
| DOMINION ENERGY INC          | 83      | 95  | 744   | 79,656  | 総合公益事業                  |
| DOMINOS PIZZA INC            | 4       | 4   | 173   | 18,553  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DOVER CORP                   | 17      | 17  | 156   | 16,768  | 機械                      |
| DOW INC                      | 89      | 89  | 306   | 32,798  | 化学                      |
| DOWDUPONT INC                | 268     | —   | —     | —       | 化学                      |
| DROPBOX INC-CLASS A          | —       | 15  | 32    | 3,510   | ソフトウェア                  |
| DUKE ENERGY CORP             | 79      | 86  | 709   | 75,918  | 電力                      |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | —       | 92  | 431   | 46,176  | 化学                      |
| EOG RESOURCES INC            | 68      | 68  | 350   | 37,472  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 31      | 31  | 127   | 13,662  | 資本市場                    |

| 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      |                      |
| EAST WEST BANCORP INC              | 19      | 19  | 66    | 7,130   | 銀行                   |
| EASTMAN CHEMICAL CO.               | 14      | 14  | 93    | 9,964   | 化学                   |
| EATON VANCE CORP                   | 16      | 16  | 59    | 6,387   | 資本市場                 |
| EBAY INC                           | 99      | 82  | 345   | 36,965  | インターネット販売・通信販売       |
| ECOLAB INC                         | 29      | 29  | 579   | 61,970  | 化学                   |
| EDISON INTERNATIONAL               | 37      | 39  | 222   | 23,795  | 電力                   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP          | 22      | 22  | 492   | 52,653  | ヘルスケア機器・用品           |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC           | 25      | 50  | 99    | 10,609  | 医薬品                  |
| ELECTRONIC ARTS                    | 37      | 31  | 367   | 39,288  | 娯楽                   |
| EMERSON ELEC                       | 69      | 69  | 387   | 41,399  | 電気設備                 |
| ENTERGY CORP                       | 18      | 24  | 229   | 24,590  | 電力                   |
| EPAM SYSTEMS INC                   | —       | 5   | 118   | 12,657  | 情報技術サービス             |
| EQUIFAX INC                        | 12      | 15  | 236   | 25,242  | 専門サービス               |
| EQUITABLE HOLDINGS INC             | —       | 41  | 73    | 7,827   | 各種金融サービス             |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A        | —       | 2   | 33    | 3,609   | 保険                   |
| ESSENTIAL UTILITIES INC            | —       | 20  | 80    | 8,620   | 水道                   |
| EVERGY INC                         | 33      | 25  | 143   | 15,374  | 電力                   |
| EVERSOURCE ENERGY                  | 33      | 34  | 269   | 28,869  | 電力                   |
| EXACT SCIENCES CORP                | —       | 16  | 138   | 14,822  | バイオテクノロジー            |
| EXELON CORPORATION                 | 106     | 115 | 430   | 46,036  | 電力                   |
| EXPEDIA GROUP INC                  | 15      | 15  | 104   | 11,186  | インターネット販売・通信販売       |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC  | 23      | 23  | 172   | 18,407  | 航空貨物・物流サービス          |
| EXXON MOBIL CORP                   | 482     | 495 | 2,285 | 244,478 | 石油・ガス・消耗燃料           |
| FLIR SYSTEMS INC                   | 12      | 12  | 57    | 6,171   | 電子装置・機器・部品           |
| FMC CORP                           | 18      | 16  | 157   | 16,796  | 化学                   |
| FACEBOOK INC-A                     | 273     | 280 | 5,945 | 635,903 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC       | —       | 3   | 99    | 10,629  | 資本市場                 |
| FASTENAL CO                        | 29      | 60  | 234   | 25,058  | 商社・流通業               |
| FEDEX CORPORATION                  | 29      | 26  | 317   | 34,005  | 航空貨物・物流サービス          |
| F5 NETWORKS INC                    | 7       | 7   | 113   | 12,112  | 通信機器                 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION      | 38      | 72  | 929   | 99,427  | 情報技術サービス             |
| FNF GROUP                          | 35      | 35  | 90    | 9,672   | 保険                   |
| FIFTH THIRD BANCORP                | 81      | 78  | 141   | 15,095  | 銀行                   |
| FIRST DATA CORP- CLASS A           | 56      | —   | —     | —       | 情報技術サービス             |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 17      | 17  | 176   | 18,892  | 銀行                   |
| FISERV INC                         | 46      | 68  | 718   | 76,874  | 情報技術サービス             |
| FIRSTENERGY CORP                   | 57      | 58  | 235   | 25,184  | 電力                   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 9       | 9   | 228   | 24,384  | 情報技術サービス             |
| FLUOR CORP                         | 14      | —   | —     | —       | 建設・土木                |
| FLOWSERVE CORP                     | 14      | 14  | 39    | 4,238   | 機械                   |
| FORD MOTOR COMPANY                 | 401     | 490 | 256   | 27,460  | 自動車                  |
| FORTINET INC                       | 15      | 15  | 205   | 21,952  | ソフトウェア               |
| FORTIVE CORP                       | 34      | 34  | 205   | 21,996  | 機械                   |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 17      | 17  | 97    | 10,437  | 建設関連製品               |
| FOX CORP-CLASS A                   | 39      | 39  | 101   | 10,844  | メディア                 |
| FOX CORP-CLASS B                   | 19      | 19  | 48    | 5,228   | メディア                 |
| FRANKLIN RESOURCES INC             | 34      | 34  | 65    | 6,981   | 資本市場                 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC              | 145     | 145 | 133   | 14,282  | 金属・鉱業                |

| 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      |                         |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 24      | 24    | 207   | 22,177  | 保険                      |
| GAP INC                       | 24      | 24    | 19    | 2,079   | 専門小売り                   |
| GARTNER INC                   | 9       | 9     | 112   | 12,061  | 情報技術サービス                |
| GENERAL DYNAMICS              | 30      | 26    | 357   | 38,215  | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL ELEC CO               | 1,001   | 1,030 | 647   | 69,289  | コングロマリット                |
| GENERAL MILLS                 | 73      | 65    | 388   | 41,543  | 食品                      |
| GENERAL MOTORS CO             | 151     | 151   | 361   | 38,645  | 自動車                     |
| GENUINE PARTS CO              | 15      | 15    | 119   | 12,753  | 販売                      |
| GILEAD SCIENCES INC           | 150     | 147   | 1,144 | 122,407 | バイオテクノロジー               |
| GLOBAL PAYMENTS INC           | 18      | 35    | 628   | 67,206  | 情報技術サービス                |
| GLOBE LIFE INC                | —       | 12    | 95    | 10,227  | 保険                      |
| GODADDY INC - CLASS A         | 18      | 18    | 135   | 14,447  | 情報技術サービス                |
| GOLDMAN SACHS GROUP           | 37      | 37    | 702   | 75,146  | 資本市場                    |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO     | 28      | —     | —     | —       | 自動車部品                   |
| GRAINGER(W.W.) INC            | 5       | 5     | 162   | 17,401  | 商社・流通業                  |
| GRUBHUB INC                   | 8       | 8     | 37    | 4,005   | インターネット販売・通信販売          |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC        | —       | 7     | 74    | 8,007   | ソフトウェア                  |
| HCA HEALTHCARE INC            | 32      | 32    | 346   | 37,049  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC        | 17      | 17    | 50    | 5,374   | 商社・流通業                  |
| HP INC                        | 184     | 185   | 289   | 30,984  | コンピュータ・周辺機器             |
| HALLIBURTON CO                | 106     | 106   | 113   | 12,130  | エネルギー設備・サービス            |
| HANESBRANDS INC               | 34      | 34    | 32    | 3,443   | 繊維・アパレル・贅品              |
| HARLEY-DAVIDSON INC           | 18      | 18    | 38    | 4,129   | 自動車                     |
| HARRIS CORP                   | 13      | —     | —     | —       | 航空宇宙・防衛                 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES   | 41      | 41    | 149   | 15,939  | 保険                      |
| HASBRO INC                    | 11      | 16    | 114   | 12,225  | レジャー用品                  |
| HEICO CORP                    | —       | 3     | 30    | 3,288   | 航空宇宙・防衛                 |
| HEICO CORP-CLASS A            | —       | 10    | 78    | 8,416   | 航空宇宙・防衛                 |
| HELMERICH & PAYNE             | 10      | —     | —     | —       | エネルギー設備・サービス            |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 9       | 9     | 177   | 18,962  | 情報技術サービス                |
| HERSHEY CO/THE                | 15      | 18    | 251   | 26,922  | 食品                      |
| HESS CORP                     | 29      | 29    | 140   | 15,036  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    | 165     | 165   | 169   | 18,087  | コンピュータ・周辺機器             |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 34      | 29    | 209   | 22,390  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HOLLYFRONTIER CORP            | 16      | 16    | 49    | 5,340   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HOLOGIC INC                   | 29      | 29    | 150   | 16,124  | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT                    | 128     | 126   | 2,965 | 317,164 | 専門小売り                   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC   | 82      | 84    | 1,150 | 122,997 | コングロマリット                |
| HORMEL FOODS CORP             | 36      | 36    | 170   | 18,188  | 食品                      |
| HOWMET AEROSPACE INC          | —       | 44    | 55    | 5,938   | 航空宇宙・防衛                 |
| HUMANA INC                    | 16      | 14    | 558   | 59,752  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC   | 8       | 8     | 90    | 9,717   | 陸運・鉄道                   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     | 119     | 119   | 102   | 11,008  | 銀行                      |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE  | 5       | 5     | 97    | 10,429  | 航空宇宙・防衛                 |
| IAC/INTERACTIVE CORP          | 9       | 9     | 223   | 23,863  | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| IPG PHOTONICS CORP            | 3       | 3     | 54    | 5,854   | 電子装置・機器・部品              |
| IDEX CORP                     | 9       | 9     | 146   | 15,717  | 機械                      |
| IDEXX LABORATORIES INC        | 8       | 9     | 261   | 28,019  | ヘルスケア機器・用品              |

| 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      |                         |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC                  | 32      | 38  | 616   | 65,952  | 機械                      |
| ILLUMINA INC                             | 17      | 17  | 539   | 57,664  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| INCYTE CORP                              | 18      | 18  | 172   | 18,465  | バイオテクノロジー               |
| INGERSOLL-RAND INC                       | —       | 34  | 102   | 10,909  | 機械                      |
| INGREDION INC                            | 6       | 6   | 58    | 6,206   | 食品                      |
| INSULET CORP                             | —       | 5   | 126   | 13,499  | ヘルスケア機器・用品              |
| INTEL CORP                               | 518     | 507 | 3,025 | 323,552 | 半導体・半導体製造装置             |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC            | 62      | 66  | 620   | 66,413  | 資本市場                    |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES          | 101     | 104 | 1,279 | 136,799 | 情報技術サービス                |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE        | 9       | 13  | 177   | 18,983  | 化学                      |
| IP (INTERNATIONAL PAPER CO)              | 44      | 44  | 151   | 16,164  | 容器・包装                   |
| INTERPUBLIC GROUP                        | 36      | 36  | 62    | 6,668   | メディア                    |
| INTUIT INC                               | 28      | 30  | 863   | 92,352  | ソフトウェア                  |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   | 13      | 13  | 720   | 77,069  | ヘルスケア機器・用品              |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC                | —       | 12  | 65    | 6,981   | バイオテクノロジー               |
| IQVIA HOLDINGS INC                       | 19      | 19  | 262   | 28,118  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| JPMORGAN CHASE & CO                      | 378     | 364 | 3,377 | 361,176 | 銀行                      |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC             | 12      | 13  | 103   | 11,118  | 建設・土木                   |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC            | 30      | 30  | 42    | 4,523   | 各種金融サービス                |
| JOHNSON & JOHNSON                        | 305     | 306 | 4,550 | 486,646 | 医薬品                     |
| JONES LANG LASALLE INC                   | 4       | 4   | 48    | 5,236   | 不動産管理・開発                |
| JUNIPER NETWORKS INC                     | 41      | 41  | 97    | 10,383  | 通信機器                    |
| KLA CORP                                 | 16      | 17  | 301   | 32,281  | 半導体・半導体製造装置             |
| KKR & CO INC-A                           | 47      | 48  | 127   | 13,686  | 資本市場                    |
| KANSAS CITY SOUTHERN                     | 12      | 12  | 172   | 18,411  | 陸運・鉄道                   |
| KELLOGG CO                               | 31      | 31  | 197   | 21,112  | 食品                      |
| KEYCORP                                  | 123     | 123 | 138   | 14,838  | 銀行                      |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC                | 23      | 23  | 231   | 24,768  | 電子装置・機器・部品              |
| KIMBERLY-CLARK CORP                      | 37      | 40  | 566   | 60,587  | 家庭用品                    |
| KINDER MORGAN INC                        | 217     | 252 | 386   | 41,370  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 13      | 13  | 49    | 5,245   | 陸運・鉄道                   |
| KOHL'S CORP                              | 21      | 21  | 38    | 4,087   | 複合小売り                   |
| KRAFT HEINZ CO/THE                       | 78      | 78  | 230   | 24,659  | 食品                      |
| KROGER CO                                | 95      | 95  | 316   | 33,874  | 食品・生活必需品小売り             |
| L BRANDS, INC                            | 26      | —   | —     | —       | 専門小売り                   |
| LKQ CORP                                 | 28      | 43  | 113   | 12,085  | 販売                      |
| L3 TECHNOLOGIES INC                      | 8       | —   | —     | —       | 航空宇宙・防衛                 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC                | —       | 26  | 479   | 51,284  | 航空宇宙・防衛                 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS             | 10      | 10  | 175   | 18,782  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH                             | 16      | 16  | 440   | 47,118  | 半導体・半導体製造装置             |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC                 | 20      | 14  | 86    | 9,214   | 食品                      |
| LAS VEGAS SANDS CORP                     | 43      | 43  | 220   | 23,589  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A              | 25      | 25  | 438   | 46,851  | パーソナル用品                 |
| LEAR CORP                                | 8       | 8   | 82    | 8,781   | 自動車部品                   |
| LEGGETT & PLATT INC                      | 14      | 14  | 41    | 4,461   | 家庭用耐久財                  |
| LEIDOS HOLDINGS INC                      | 18      | 18  | 184   | 19,770  | 情報技術サービス                |
| LENNAR CORP-A                            | 30      | 30  | 162   | 17,329  | 家庭用耐久財                  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC                 | 5       | 3   | 57    | 6,143   | 建設関連製品                  |

| 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        |                         |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C     | 13      | 13  | 170    | 18,216    | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP       | 11      | 11  | 38     | 4,116     | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C       | 20      | 20  | 66     | 7,140     | メディア                    |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 19      | 19  | 58     | 6,240     | 娯楽                      |
| ELI LILLY & CO.              | 100     | 101 | 1,555  | 166,313   | 医薬品                     |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 22      | 22  | 80     | 8,623     | 保険                      |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 14      | 14  | 58     | 6,282     | 娯楽                      |
| LOCKHEED MARTIN              | 28      | 29  | 1,131  | 121,004   | 航空宇宙・防衛                 |
| LOEWS CORP                   | 28      | 28  | 86     | 9,289     | 保険                      |
| LOWES COS INC                | 93      | 89  | 1,017  | 108,852   | 専門小売り                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 10      | 11  | 278    | 29,780    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| M & T BANK CORP              | 14      | 14  | 147    | 15,814    | 銀行                      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 65      | 65  | 101    | 10,837    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MSCI INC                     | 10      | 10  | 356    | 38,173    | 資本市場                    |
| MACYS INC                    | 37      | —   | —      | —         | 複合小売り                   |
| MANPOWERGROUP INC            | 5       | 5   | 42     | 4,533     | 専門サービス                  |
| MARATHON OIL CORP            | 108     | 108 | 62     | 6,676     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 76      | 76  | 251    | 26,847    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARKEL CORP                  | 1       | 1   | 125    | 13,394    | 保険                      |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | —       | 5   | 242    | 25,899    | 資本市場                    |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 57      | 57  | 601    | 64,277    | 保険                      |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA   | 31      | 31  | 273    | 29,273    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 6       | 6   | 111    | 11,898    | 建設資材                    |
| MASCO CORP                   | 33      | 33  | 139    | 14,872    | 建設関連製品                  |
| MASTERCARD INC               | 104     | 104 | 2,957  | 316,266   | 情報技術サービス                |
| MATCH GROUP INC              | —       | 4   | 31     | 3,421     | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| MATTEL INC                   | 34      | —   | —      | —         | レジャー用品                  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 28      | 28  | 151    | 16,206    | 半導体・半導体製造装置             |
| MCCORMICK & CO INC.          | 14      | 14  | 237    | 25,437    | 食品                      |
| MCDONALD'S CORP              | 87      | 87  | 1,583  | 169,403   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MCKESSON CORP                | 24      | 20  | 274    | 29,374    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 30      | 30  | 50     | 5,371     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MERCADOLIBRE INC             | 4       | 5   | 439    | 46,986    | インターネット販売・通信販売          |
| MERCK & CO INC               | 295     | 297 | 2,270  | 242,841   | 医薬品                     |
| METLIFE INC                  | 100     | 90  | 316    | 33,901    | 保険                      |
| METTLER-TOLEDO INTL          | 3       | 3   | 215    | 23,087    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| MICROSOFT CORP               | 823     | 841 | 15,538 | 1,661,893 | ソフトウェア                  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 26      | 26  | 238    | 25,518    | 半導体・半導体製造装置             |
| MICRON TECHNOLOGY            | 123     | 125 | 603    | 64,504    | 半導体・半導体製造装置             |
| MIDDLEBY CORP                | 6       | 6   | 42     | 4,542     | 機械                      |
| MOHAWK INDUSTRIES            | 6       | 6   | 56     | 5,990     | 家庭用耐久財                  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B   | 19      | 19  | 76     | 8,152     | 飲料                      |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC   | 161     | 170 | 865    | 92,543    | 食品                      |
| MONGODB INC                  | —       | 6   | 112    | 12,080    | 情報技術サービス                |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 48      | 48  | 315    | 33,768    | 飲料                      |
| MOODYS CORP                  | 21      | 18  | 460    | 49,272    | 資本市場                    |
| MORGAN STANLEY               | 143     | 143 | 573    | 61,297    | 資本市場                    |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD    | 25      | 45  | 21     | 2,310     | 食品・生活必需品小売り             |

| 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      |              |
| MOSAIC CO/THE                | 36      | 36   | 43    | 4,662   | 化学           |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 19      | 19   | 254   | 27,236  | 通信機器         |
| NRG ENERGY INC               | 28      | 28   | 91    | 9,813   | 電力           |
| NVR INC                      | 0.44    | 0.44 | 137   | 14,680  | 家庭用耐久財       |
| NASDAQ INC                   | 14      | 14   | 153   | 16,454  | 資本市場         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 42      | 42   | 55    | 5,924   | エネルギー設備・サービス |
| NEKTAR THERAPEUTICS          | 22      | —    | —     | —       | 医薬品          |
| NETAPP INC                   | 29      | 29   | 130   | 13,925  | コンピュータ・周辺機器  |
| NETFLIX INC                  | 48      | 51   | 2,230 | 238,500 | 娯楽           |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | —       | 8    | 89    | 9,594   | バイオテクノロジー    |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 150     | 130  | 53    | 5,714   | 不動産管理・開発     |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 25      | 25   | 113   | 12,165  | コングロマリット     |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 31      | 26   | 56    | 6,048   | コングロマリット     |
| NEWELL BRANDS INC            | 59      | 59   | 73    | 7,830   | 家庭用耐久財       |
| NEWMONT CORP                 | 70      | 96   | 623   | 66,661  | 金属・鉱業        |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I       | 43      | 43   | 46    | 5,026   | メディア         |
| NEXTERA ENERGY INC           | 54      | 57   | 1,316 | 140,783 | 電力           |
| NIKE INC-B                   | 148     | 145  | 1,316 | 140,766 | 繊維・アパレル・贅沢品  |
| NISOURCE INC                 | 47      | 47   | 109   | 11,697  | 総合公益事業       |
| NOBLE ENERGY INC             | 50      | 50   | 50    | 5,363   | 石油・ガス・消耗燃料   |
| NORDSTROM INC                | 16      | 16   | 28    | 3,085   | 複合小売り        |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 30      | 30   | 524   | 56,068  | 陸運・鉄道        |
| NORTHERN TRUST CORP          | 21      | 21   | 165   | 17,717  | 資本市場         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 19      | 19   | 622   | 66,580  | 航空宇宙・防衛      |
| NORTONLIFELOCK INC           | —       | 67   | 142   | 15,248  | ソフトウェア       |
| NUCOR CORP                   | 33      | 33   | 139   | 14,893  | 金属・鉱業        |
| NVIDIA CORP                  | 65      | 68   | 2,125 | 227,268 | 半導体・半導体製造装置  |
| OGE ENERGY CORP              | 27      | 27   | 83    | 8,966   | 電力           |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,      | 8       | 8    | 346   | 37,021  | 専門小売り        |
| OCCIDENTAL PETE CORP         | 83      | 100  | 151   | 16,206  | 石油・ガス・消耗燃料   |
| OKTA INC                     | —       | 14   | 240   | 25,723  | 情報技術サービス     |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 5       | 9    | 142   | 15,194  | 陸運・鉄道        |
| OMNICOM GROUP                | 26      | 26   | 144   | 15,442  | メディア         |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 39      | 39   | 66    | 7,140   | 半導体・半導体製造装置  |
| ONEOK INC                    | 46      | 46   | 144   | 15,413  | 石油・ガス・消耗燃料   |
| ORACLE CORPORATION           | 300     | 269  | 1,441 | 154,118 | ソフトウェア       |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | —       | 48   | 255   | 27,352  | 機械           |
| OWENS CORNING INC            | 10      | 10   | 45    | 4,898   | 建設関連製品       |
| PNC FINANCIAL                | 50      | 49   | 521   | 55,827  | 銀行           |
| PPG INDUSTRIES               | 28      | 28   | 263   | 28,232  | 化学           |
| PPL CORPORATION              | 91      | 92   | 240   | 25,690  | 電力           |
| PVH CORP                     | 9       | 9    | 42    | 4,577   | 繊維・アパレル・贅沢品  |
| PTC INC                      | 15      | 15   | 113   | 12,167  | ソフトウェア       |
| PACCAR                       | 38      | 38   | 270   | 28,964  | 機械           |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 10      | 10   | 103   | 11,020  | 容器・包装        |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 10      | 10   | 216   | 23,111  | ソフトウェア       |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 14      | 14   | 225   | 24,106  | 機械           |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 35      | —    | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料   |

| 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      |                         |
| PAYCHEX INC                   | —       | 34  | 228   | 24,403  | 情報技術サービス                |
| PAYCOM SOFTWARE INC           | 34      | 4   | 133   | 14,255  | ソフトウェア                  |
| PAYPAL HOLDINGS INC           | 124     | 130 | 1,897 | 202,940 | 情報技術サービス                |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC  | 57      | 57  | 68    | 7,351   | 銀行                      |
| PEPSICO INC                   | 159     | 162 | 2,186 | 233,857 | 飲料                      |
| PERKINELMER INC               | —       | 10  | 93    | 9,989   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| PFIZER INC                    | —       | 646 | 2,404 | 257,151 | 医薬品                     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   | 173     | 183 | 1,317 | 140,917 | タバコ                     |
| PHILLIPS 66                   | 48      | 49  | 382   | 40,878  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP    | 11      | 11  | 84    | 9,085   | 電力                      |
| PINTEREST INC- CLASS A        | —       | 45  | 89    | 9,524   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  | 17      | 17  | 158   | 16,938  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A    | 20      | —   | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| POLARIS INC                   | 6       | 6   | 46    | 4,991   | レジャー用品                  |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 27      | 27  | 311   | 33,302  | 資本市場                    |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 30      | 30  | 117   | 12,586  | 保険                      |
| PROCTER & GAMBLE CO           | 283     | 290 | 3,368 | 360,244 | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CO                | 64      | 69  | 518   | 55,443  | 保険                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 45      | 44  | 261   | 27,944  | 保険                      |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE         | 57      | 57  | 277   | 29,730  | 総合公益事業                  |
| PULTEGROUP INC                | 28      | 28  | 83    | 8,947   | 家庭用耐久財                  |
| QORVO INC                     | 12      | 12  | 123   | 13,219  | 半導体・半導体製造装置             |
| QUALCOMM INC                  | 135     | 135 | 1,087 | 116,314 | 半導体・半導体製造装置             |
| QUEST DIAGNOSTICS INC         | 13      | 13  | 152   | 16,322  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| QURATE RETAIL INC - A         | 51      | —   | —     | —       | インターネット販売・通信販売          |
| RPM INTERNATIONAL INC         | —       | 12  | 82    | 8,833   | 化学                      |
| RALPH LAUREN CORPORATION      | 6       | 6   | 46    | 4,933   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 13      | 13  | 86    | 9,291   | 資本市場                    |
| RAYTHEON COMPANY              | 33      | —   | —     | —       | 航空宇宙・防衛                 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP    | —       | 174 | 1,024 | 109,544 | 航空宇宙・防衛                 |
| RED HAT INC                   | 19      | —   | —     | —       | ソフトウェア                  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 8       | 8   | 495   | 53,024  | バイオテクノロジー               |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 123     | 123 | 126   | 13,575  | 銀行                      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 7       | 7   | 71    | 7,620   | 保険                      |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A    | 23      | 28  | 234   | 25,044  | 商業サービス・用品               |
| RESMED INC                    | 16      | 16  | 273   | 29,242  | ヘルスケア機器・用品              |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A       | —       | 9   | 261   | 27,956  | ソフトウェア                  |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 14      | 14  | 67    | 7,246   | 専門サービス                  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 12      | 12  | 244   | 26,139  | 電気設備                    |
| ROKU INC                      | —       | 11  | 140   | 15,036  | 娯楽                      |
| ROLLINS INC                   | 15      | 15  | 63    | 6,784   | 商業サービス・用品               |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 12      | 12  | 430   | 45,991  | コングロマリット                |
| ROSS STORES INC               | 43      | 43  | 397   | 42,550  | 専門小売り                   |
| S&P GLOBAL INC                | 27      | 28  | 833   | 89,134  | 資本市場                    |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 14      | 14  | 72    | 7,770   | 資本市場                    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS    | 22      | 22  | 128   | 13,764  | ソフトウェア                  |
| SVB FINANCIAL GROUP           | 6       | 6   | 117   | 12,522  | 銀行                      |
| SABRE CORP                    | 37      | 37  | 24    | 2,661   | 情報技術サービス                |

| 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      |                         |
| SALESFORCE.COM INC                | 86      | 97  | 1,716 | 183,610 | ソフトウェア                  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC          | —       | 11  | 140   | 15,058  | バイオテクノロジー               |
| HENRY SCHEIN INC                  | 21      | 21  | 113   | 12,134  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD                  | 162     | 162 | 292   | 31,273  | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP             | 143     | 131 | 478   | 51,152  | 資本市場                    |
| SEALED AIR CORP                   | 15      | 15  | 44    | 4,754   | 容器・包装                   |
| SEATTLE GENETICS INC              | 11      | 16  | 255   | 27,317  | バイオテクノロジー               |
| SEMPRA ENERGY                     | 29      | 34  | 422   | 45,173  | 総合公益事業                  |
| SERVICENOW INC                    | 19      | 21  | 822   | 87,958  | ソフトウェア                  |
| SHERWIN-WILLIAMS                  | 9       | 9   | 527   | 56,436  | 化学                      |
| SIGNATURE BANK                    | 5       | 5   | 53    | 5,731   | 銀行                      |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC            | 170     | 170 | 97    | 10,445  | メディア                    |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC            | 19      | 19  | 216   | 23,195  | 半導体・半導体製造装置             |
| SMITH (A. O.) CORP                | 14      | 14  | 62    | 6,706   | 建設関連製品                  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW             | 12      | 12  | 142   | 15,270  | 食品                      |
| SNAP-ON INC                       | 5       | 5   | 70    | 7,489   | 機械                      |
| SNAP INC-A                        | —       | 95  | 173   | 18,522  | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SOUTHERN CO.                      | 114     | 124 | 687   | 73,483  | 電力                      |
| SOUTHWEST AIRLINES                | 15      | 15  | 40    | 4,363   | 旅客航空輸送業                 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A      | 11      | 11  | 22    | 2,454   | 航空宇宙・防衛                 |
| SPLUNK INC                        | 17      | 17  | 268   | 28,680  | ソフトウェア                  |
| SPRINT CORP                       | 73      | —   | —     | —       | 無線通信サービス                |
| SQUARE INC - A                    | 33      | 41  | 311   | 33,347  | 情報技術サービス                |
| STANLEY BLACK & DECKER INC        | 15      | 16  | 190   | 20,328  | 機械                      |
| STARBUCKS CORP                    | 139     | 137 | 1,066 | 114,096 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STATE STREET CORP                 | 45      | 45  | 270   | 28,982  | 資本市場                    |
| STEEL DYNAMICS                    | 21      | 21  | 53    | 5,697   | 金属・鉱業                   |
| STRYKER CORP                      | 39      | 40  | 768   | 82,171  | ヘルスケア機器・用品              |
| SUNTRUST BKS INC.                 | 52      | —   | —     | —       | 銀行                      |
| SYMANTEC CORP                     | 67      | —   | —     | —       | ソフトウェア                  |
| SYNOPSIS INC                      | 17      | 17  | 285   | 30,491  | ソフトウェア                  |
| SYNCHRONY FINANCIAL               | 68      | 68  | 126   | 13,541  | 消費者金融                   |
| SYSCO CORP                        | 53      | 55  | 293   | 31,346  | 食品・生活必需品小売り             |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP        | 36      | 36  | 136   | 14,588  | 資本市場                    |
| TJX COS INC                       | 136     | 141 | 683   | 73,152  | 専門小売り                   |
| T-MOBILE US INC                   | 39      | 46  | 457   | 48,974  | 無線通信サービス                |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A         | 6       | —   | —     | —       | ソフトウェア                  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 13      | 13  | 179   | 19,164  | 娯楽                      |
| TAPESTRY INC                      | 33      | 33  | 49    | 5,251   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| TARGET CORP                       | 60      | 59  | 693   | 74,204  | 複合小売り                   |
| TARGA RESOURCES CORP              | 28      | 28  | 38    | 4,132   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC         | —       | 3   | 119   | 12,810  | 航空宇宙・防衛                 |
| TELEFLEX INC                      | 5       | 5   | 173   | 18,561  | ヘルスケア機器・用品              |
| TERADYNE INC                      | —       | 16  | 104   | 11,138  | 半導体・半導体製造装置             |
| TESLA INC                         | 15      | 15  | 1,286 | 137,590 | 自動車                     |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR        | 117     | 118 | 133   | 14,248  | 医薬品                     |
| TEXAS INSTRUMENTS INC             | 106     | 109 | 1,263 | 135,168 | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXTRON INC                       | 28      | 28  | 76    | 8,175   | 航空宇宙・防衛                 |

| 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      |                         |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 46      | 47  | 1,565 | 167,392 | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| 3M CORP                      | 64      | 67  | 1,006 | 107,687 | コングロマリット                |
| TIFFANY & CO                 | 13      | 13  | 178   | 19,111  | 専門小売り                   |
| TORCHMARK CORP               | 12      | —   | —     | —       | 保険                      |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | 16      | —   | —     | —       | 情報技術サービス                |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 16      | 16  | 171   | 18,345  | 専門小売り                   |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 4       | 6   | 215   | 23,004  | 航空宇宙・防衛                 |
| TRUNSONION                   | 23      | 23  | 181   | 19,459  | 専門サービス                  |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 28      | 28  | 272   | 29,149  | 保険                      |
| TRIMBLE INC                  | 25      | 25  | 92    | 9,892   | 電子装置・機器・部品              |
| TRIPADVISOR INC              | 13      | 13  | 23    | 2,490   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | —       | 160 | 579   | 62,013  | 銀行                      |
| TWILIO INC - A               | —       | 14  | 262   | 28,058  | 情報技術サービス                |
| TWITTER INC                  | 83      | 83  | 248   | 26,568  | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | —       | 3   | 122   | 13,067  | ソフトウェア                  |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 31      | 31  | 187   | 20,022  | 食品                      |
| UGI CORP                     | 25      | 25  | 77    | 8,259   | ガス                      |
| US BANCORP                   | 178     | 176 | 611   | 65,410  | 銀行                      |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | —       | 57  | 186   | 19,989  | 陸運・鉄道                   |
| ULTA BEAUTY INC              | 6       | 6   | 142   | 15,255  | 専門小売り                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 21      | 21  | 20    | 2,241   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | 21      | 21  | 18    | 2,021   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNION PAC CORP               | 82      | 81  | 1,291 | 138,115 | 陸運・鉄道                   |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 8       | 8   | 21    | 2,338   | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 77      | 82  | 785   | 83,976  | 航空貨物・物流サービス             |
| UNITED RENTALS INC           | 8       | 8   | 95    | 10,231  | 商社・流通業                  |
| UNITED TECHNOLOGIES          | 94      | —   | —     | —       | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 4       | —   | —     | —       | バイオテクノロジー               |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 109     | 110 | 3,171 | 339,175 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 8       | 8   | 88    | 9,496   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNUM GROUP                   | 27      | 27  | 41    | 4,481   | 保険                      |
| V F CORP                     | 37      | 37  | 216   | 23,167  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VAIL RESORTS INC             | 5       | 5   | 89    | 9,520   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| VALERO ENERGY CORP           | 51      | 45  | 298   | 31,937  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 10      | 10  | 125   | 13,456  | ヘルスケア機器・用品              |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 15      | 15  | 288   | 30,856  | ヘルスケア・テクノロジ             |
| VERISIGN INC                 | 13      | 11  | 231   | 24,710  | 情報技術サービス                |
| VERIZON COMMUNICATIONS       | 469     | 482 | 2,747 | 293,834 | 各種電気通信サービス              |
| VERISK ANALYTICS INC         | 17      | 17  | 274   | 29,353  | 専門サービス                  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS       | 30      | 30  | 828   | 88,605  | バイオテクノロジー               |
| VIACOM INC-CLASS B           | 36      | —   | —     | —       | 娯楽                      |
| VIACOMCBS INC-CLASS B        | —       | 58  | 105   | 11,304  | メディア                    |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 200     | 199 | 3,694 | 395,115 | 情報技術サービス                |
| VISTRA ENERGY CORP           | 46      | 46  | 86    | 9,298   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| VMWARE INC - CLASS A         | 9       | 9   | 126   | 13,505  | ソフトウェア                  |
| VOYA FINANCIAL INC           | 21      | 21  | 94    | 10,082  | 各種金融サービス                |
| VULCAN MATERIALS CO          | 15      | 15  | 153   | 16,436  | 建設資材                    |
| WABCO HOLDINGS INC           | 6       | 6   | 83    | 8,882   | 機械                      |

| 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      |                         |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 36      | 36  | 308   | 32,988  | 総合公益事業                  |
| WABTEC CORP                  | 13      | 22  | 126   | 13,486  | 機械                      |
| WALMART INC                  | 164     | 166 | 2,043 | 218,526 | 食品・生活必需品小売り             |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 89      | 89  | 370   | 39,663  | 食品・生活必需品小売り             |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 30      | 30  | 278   | 29,733  | 商業サービス・用品               |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 46      | 46  | 465   | 49,782  | 商業サービス・用品               |
| WATERS CORP                  | 8       | 8   | 151   | 16,197  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| WAYFAIR INC - CLASS A        | 4       | 8   | 157   | 16,894  | インターネット販売・通信販売          |
| WELL CARE HEALTH PLANS INC   | 6       | —   | —     | —       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WELLS FARGO CO               | 508     | 471 | 1,197 | 128,099 | 銀行                      |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | —       | 7   | 140   | 14,973  | ヘルスケア機器・用品              |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 30      | 30  | 134   | 14,370  | コンピュータ・周辺機器             |
| WESTERN UNION CO             | 55      | 55  | 109   | 11,723  | 情報技術サービス                |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 2       | 2   | 12    | 1,303   | 化学                      |
| WESTROCK CO                  | 29      | 29  | 78    | 8,374   | 容器・包装                   |
| WHIRLPOOL CORP               | 7       | 7   | 78    | 8,429   | 家庭用耐久財                  |
| WILLIAMS COS                 | 146     | 146 | 284   | 30,401  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 15      | 18  | 307   | 32,932  | ソフトウェア                  |
| WORLDPAY INC - CL A          | 32      | —   | —     | —       | 情報技術サービス                |
| WYNN RESORTS LTD             | 9       | 9   | 83    | 8,926   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| XPO LOGISTICS INC            | 14      | 8   | 54    | 5,852   | 航空貨物・物流サービス             |
| XCEL ENERGY INC              | 57      | 57  | 343   | 36,765  | 電力                      |
| XILINX INC                   | 27      | 26  | 232   | 24,896  | 半導体・半導体製造装置             |
| XEROX CORP                   | 25      | —   | —     | —       | コンピュータ・周辺機器             |
| XYLEM INC                    | 21      | 21  | 135   | 14,486  | 機械                      |
| XEROX HOLDINGS CORP          | —       | 25  | 45    | 4,847   | コンピュータ・周辺機器             |
| YUM BRANDS INC               | 37      | 38  | 328   | 35,116  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | 18      | —   | —     | —       | 各種電気通信サービス              |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | —       | 5   | 128   | 13,769  | 電子装置・機器・部品              |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 11      | 11  | 59    | 6,344   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 25      | 25  | 304   | 32,582  | ヘルスケア機器・用品              |
| ZIONS BANCORP NA             | 23      | 23  | 70    | 7,556   | 銀行                      |
| ZOETIS INC                   | 52      | 56  | 708   | 75,817  | 医薬品                     |
| ALKERMES PLC                 | 16      | —   | —     | —       | バイオテクノロジー               |
| ALLEGION PLC                 | 14      | 8   | 91    | 9,734   | 建設関連製品                  |
| ALLERGAN PLC                 | 40      | 38  | 750   | 80,303  | 医薬品                     |
| AMCOR PLC                    | —       | 194 | 174   | 18,611  | 容器・包装                   |
| AON PLC                      | —       | 28  | 531   | 56,825  | 保険                      |
| AON PLC                      | 26      | —   | —     | —       | 保険                      |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 39      | 41  | 106   | 11,378  | 保険                      |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 20      | 20  | 54    | 5,839   | 保険                      |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 29      | 29  | 56    | 6,082   | 化学                      |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 74      | 74  | 1,404 | 150,240 | 情報技術サービス                |
| BUNGE LIMITED                | 17      | 17  | 62    | 6,641   | 食品                      |
| CAPRI HOLDINGS LTD           | 19      | 19  | 28    | 3,050   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 21      | 23  | 90    | 9,691   | 飲料                      |
| EATON CORP PLC               | 53      | 45  | 373   | 39,936  | 電気設備                    |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 4       | 4   | 77    | 8,319   | 保険                      |

| 銘柄                                     | 株数           | 株数     | 当 期 末  |         | 業 種 等          |  |
|--|--------------|--------|--------|---------|----------------|--|
|  |              |        | 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      |                |  |
| IHS MARKIT LTD                         | 45           | 45     | 301    | 32,279  | 専門サービス         |  |
| INGERSOLL-RAND PLC                     | 28           | —      | —      | —       | 機械             |  |
| INVESCO LTD                            | 44           | 44     | 35     | 3,755   | 資本市場           |  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC               | 5            | 5      | 60     | 6,496   | 医薬品            |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC     | 107          | 93     | 277    | 29,640  | 建設関連製品         |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A                   | 23           | 23     | 50     | 5,347   | メディア           |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C           | 53           | 53     | 113    | 12,124  | メディア           |  |
| LINDE PLC                              | 63           | 63     | 1,190  | 127,350 | 化学             |  |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD           | 74           | 74     | 198    | 21,249  | 半導体・半導体製造装置    |  |
| MEDTRONIC PLC                          | 149          | 157    | 1,555  | 166,388 | ヘルスケア機器・用品     |  |
| APTIV PLC                              | 29           | 29     | 201    | 21,501  | 自動車部品          |  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC                   | 37           | 37     | 52     | 5,599   | 専門サービス         |  |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN           | 26           | 26     | 32     | 3,456   | ホテル・レストラン・レジャー |  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD             | 4            | 4      | 78     | 8,404   | 保険             |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY                     | 32           | 32     | 163    | 17,474  | コンピュータ・周辺機器    |  |
| PENTAIR PLC                            | 21           | 21     | 73     | 7,883   | 機械             |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING           | 16           | 16     | 58     | 6,281   | 電気設備           |  |
| STERIS PLC                             | —            | 11     | 169    | 18,075  | ヘルスケア機器・用品     |  |
| TECHNIPFMC PLC                         | 52           | 52     | 41     | 4,404   | エネルギー設備・サービス   |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC                 | —            | 28     | 238    | 25,542  | 建設関連製品         |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC               | 16           | 13     | 268    | 28,704  | 保険             |  |
| PERRIGO CO PLC                         | 17           | 17     | 89     | 9,570   | 医薬品            |  |
| CHUBB LTD                              | 50           | 53     | 549    | 58,770  | 保険             |  |
| GARMIN LTD                             | 17           | 17     | 138    | 14,788  | 家庭用耐久財         |  |
| TE CONNECTIVITY LTD                    | 37           | 37     | 285    | 30,535  | 電子装置・機器・部品     |  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 14           | 14     | 152    | 16,362  | ソフトウェア         |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL           | —            | 5      | 55     | 5,948   | ソフトウェア         |  |
| WIX.COM LTD                            | 4            | 5      | 84     | 9,066   | 情報技術サービス       |  |
| AERCAP HOLDINGS NV                     | 14           | 14     | 42     | 4,554   | 商社・流通業         |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A               | 40           | 29     | 163    | 17,508  | 化学             |  |
| MYLAN NV                               | 61           | 61     | 107    | 11,462  | 医薬品            |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV                  | 38           | 34     | 358    | 38,347  | 半導体・半導体製造装置    |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD            | 19           | 19     | 77     | 8,282   | ホテル・レストラン・レジャー |  |
| FLEX LTD                               | 47           | 47     | 47     | 5,031   | 電子装置・機器・部品     |  |
| 小 計                                    | 株 数 ・ 金 額    | 34,258 | 34,863 | 289,931 | 31,008,183     |  |
|  | 銘柄 数 < 比 率 > | 597    | 608    | —       | <67.8%>        |  |
| (カナダ)                                  |              |        | 千カナダドル |         |                |  |
| ARC RESOURCES LTD                      | 38           | —      | —      | —       | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                 | 32           | 24     | 220    | 16,903  | 金属・鉱業          |  |
| AIR CANADA                             | —            | 20     | 34     | 2,616   | 旅客航空輸送業        |  |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES            | —            | 73     | 138    | 10,643  | 総合公益事業         |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B             | 53           | 91     | 368    | 28,282  | 食品・生活必需品小売り    |  |
| ALTAGAS LTD                            | 36           | 36     | 59     | 4,544   | ガス             |  |
| ATCO LTD CL1                           | 9            | 9      | 33     | 2,604   | 総合公益事業         |  |
| AURORA CANNABIS INC                    | 90           | 90     | 8      | 628     | 医薬品            |  |
| BCE INC                                | 22           | 22     | 124    | 9,580   | 各種電気通信サービス     |  |
| BANK OF MONTREAL                       | 71           | 72     | 492    | 37,759  | 銀行             |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX            | 141          | 140    | 741    | 56,887  | 銀行             |  |

| 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     |             |
| BARRICK GOLD                       | 184     | 214 | 815    | 62,618 | 金属・鉱業       |
| BAUSCH HEALTH COS INC              | 39      | 39  | 91     | 6,994  | 医薬品         |
| BLACKBERRY LTD                     | 45      | 45  | 29     | 2,261  | ソフトウェア      |
| BOMBARDIER B SHEARS                | 195     | 195 | 8      | 658    | 航空宇宙・防衛     |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A       | 92      | 153 | 711    | 54,596 | 資本市場        |
| CAE INC                            | 38      | 23  | 50     | 3,888  | 航空宇宙・防衛     |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B          | 14      | 14  | 63     | 4,896  | 容器・包装       |
| CGI INC                            | 30      | 30  | 271    | 20,869 | 情報技術サービス    |
| CI FINANCIAL CORP                  | 37      | 37  | 54     | 4,154  | 資本市場        |
| CAMECO CORP                        | 50      | 50  | 74     | 5,743  | 石油・ガス・消耗燃料  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 48      | 47  | 391    | 30,019 | 銀行          |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO           | 81      | 84  | 969    | 74,364 | 陸運・鉄道       |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD     | 131     | 147 | 335    | 25,765 | 石油・ガス・消耗燃料  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD       | 15      | 16  | 520    | 39,922 | 陸運・鉄道       |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A           | 6       | 6   | 66     | 5,069  | 複合小売り       |
| CANADIAN UTILITIES LTD A           | 10      | 10  | 35     | 2,700  | 総合公益事業      |
| CANOPY GROWTH CORP                 | 28      | 28  | 59     | 4,585  | 医薬品         |
| CENOVUS ENERGY INC                 | 140     | 140 | 75     | 5,780  | 石油・ガス・消耗燃料  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC         | 2       | 2   | 345    | 26,533 | ソフトウェア      |
| CRONOS GROUP INC                   | 16      | 16  | 12     | 923    | 医薬品         |
| DOLLARAMA INC                      | 31      | 31  | 137    | 10,522 | 複合小売り       |
| EMERA INC                          | 6       | 33  | 179    | 13,778 | 電力          |
| EMPIRE CO LTD A                    | 13      | 13  | 40     | 3,089  | 食品・生活必需品小売り |
| ENCANA CORP                        | 140     | —   | —      | —      | 石油・ガス・消耗燃料  |
| ENBRIDGE INC                       | 232     | 240 | 1,071  | 82,234 | 石油・ガス・消耗燃料  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD        | 3       | 3   | 114    | 8,815  | 保険          |
| FINNING INTERNATIONAL INC          | 20      | —   | —      | —      | 商社・流通業      |
| FIRST CAPITAL REALTY INC           | 11      | —   | —      | —      | 不動産管理・開発    |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD         | 78      | 78  | 69     | 5,321  | 金属・鉱業       |
| FORTIS INC                         | 50      | 50  | 266    | 20,432 | 電力          |
| FRANCO-NEVADA CORP                 | 24      | 21  | 436    | 33,511 | 金属・鉱業       |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC              | 27      | 27  | 51     | 3,982  | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GREAT-WEST LIFE CO INC             | 38      | —   | —      | —      | 保険          |
| GREAT-WEST LIFE CO INC             | —       | 38  | 81     | 6,284  | 保険          |
| HUSKY ENERGY INC                   | 37      | —   | —      | —      | 石油・ガス・消耗燃料  |
| HUSKY ENERGY INC                   | —       | 37  | 15     | 1,186  | 石油・ガス・消耗燃料  |
| HYDRO ONE LTD                      | 31      | 31  | 79     | 6,082  | 電力          |
| IGM FINANCIAL INC                  | 6       | 6   | 16     | 1,293  | 資本市場        |
| IA FINANCIAL CORP INC              | 8       | 8   | 33     | 2,558  | 保険          |
| IMPERIAL OIL                       | 29      | 29  | 61     | 4,717  | 石油・ガス・消耗燃料  |
| INTACT FINANCIAL CORP              | 14      | 14  | 201    | 15,466 | 保険          |
| INTER PIPELINE LTD                 | 38      | 38  | 41     | 3,213  | 石油・ガス・消耗燃料  |
| KEYERA CORP                        | 20      | 20  | 41     | 3,222  | 石油・ガス・消耗燃料  |
| KINROSS GOLD CORP                  | 100     | 100 | 97     | 7,512  | 金属・鉱業       |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD             | —       | 28  | 167    | 12,845 | 金属・鉱業       |
| LOBLAW COMPANIES                   | 24      | 24  | 166    | 12,756 | 食品・生活必需品小売り |
| LUNDIN MINING CORP                 | 80      | 80  | 50     | 3,892  | 金属・鉱業       |
| MAGNA INTERNATIONAL INC            | 39      | 30  | 165    | 12,719 | 自動車部品       |

| 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       |                |           |
| MANULIFE FINANCIAL CORP             | 229     | 229 | 391    | 30,015   | 保険             |           |
| METHANEX CORP                       | 9       | 9   | 21     | 1,649    | 化学             |           |
| METRO INC                           | 24      | 34  | 196    | 15,047   | 食品・生活必需品小売り    |           |
| NATIONAL BANK OF CANADA             | 34      | 35  | 194    | 14,906   | 銀行             |           |
| NEWMONT CORP                        | 26      | —   | —      | —        | 金属・鉱業          |           |
| NUTRIEN LTD                         | 67      | 67  | 330    | 25,399   | 化学             |           |
| ONEX CORPORATION                    | 9       | 9   | 59     | 4,558    | 各種金融サービス       |           |
| OPEN TEXT CORP                      | 31      | 31  | 170    | 13,110   | ソフトウェア         |           |
| OVINTIV INC                         | —       | 28  | 22     | 1,729    | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| PARKLAND FUEL CORP                  | —       | 12  | 39     | 3,066    | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| PEMBINA PIPELINE CORP               | 52      | 65  | 206    | 15,877   | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| POWER CORPORATION OF CANADA         | 35      | 69  | 146    | 11,208   | 保険             |           |
| POWER FINANCIAL CORP                | 33      | —   | —      | —        | 保険             |           |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD              | 18      | 18  | 17     | 1,324    | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| QUEBECOR INC-CL B                   | —       | 14  | 41     | 3,213    | メディア           |           |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 27      | 37  | 266    | 20,435   | ホテル・レストラン・レジャー |           |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B          | 42      | 42  | 239    | 18,345   | 無線通信サービス       |           |
| ROYAL BANK OF CANADA                | 161     | 169 | 1,442  | 110,677  | 銀行             |           |
| SNC-LAVALIN GROUP INC               | 19      | —   | —      | —        | 建設・土木          |           |
| SAPUTO INC                          | 31      | 31  | 107    | 8,228    | 食品             |           |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A        | 31      | —   | —      | —        | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B           | 61      | 61  | 140    | 10,757   | メディア           |           |
| SHOPIFY INC - CLASS A               | 10      | 12  | 1,226  | 94,116   | 情報技術サービス       |           |
| STARS GROUP INC/THE                 | 14      | —   | —      | —        | ホテル・レストラン・レジャー |           |
| SUN LIFE FINANCIAL INC              | 68      | 68  | 329    | 25,261   | 保険             |           |
| SUNCOR ENERGY INC                   | 185     | 188 | 448    | 34,379   | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| TC ENERGY CORP                      | 102     | 112 | 719    | 55,196   | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B            | 61      | 61  | 77     | 5,963    | 金属・鉱業          |           |
| TELUS CORP                          | 26      | 52  | 118    | 9,118    | 各種電気通信サービス     |           |
| THOMSON REUTERS CORP                | 24      | 24  | 232    | 17,876   | 専門サービス         |           |
| TORONTO DOMINION BANK               | 211     | 214 | 1,220  | 93,656   | 銀行             |           |
| TOURMALINE OIL CORP                 | 28      | —   | —      | —        | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD        | 87      | —   | —      | —        | 金属・鉱業          |           |
| VERMILION ENERGY INC                | 14      | —   | —      | —        | 石油・ガス・消耗燃料     |           |
| WSP GLOBAL INC                      | 11      | 11  | 97     | 7,474    | 建設・土木          |           |
| WEST FRASER TIMBER                  | 7       | 7   | 31     | 2,400    | 紙製品・林産品        |           |
| WESTON(GEORGE)LTD                   | 7       | 7   | 69     | 5,363    | 食品・生活必需品小売り    |           |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP        | 43      | 45  | 271    | 20,851   | 金属・鉱業          |           |
| 小 計                                 | 株 数     | 金 額 | 4,637  | 4,622    | 19,669         | 1,509,448 |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                       | 89      | 83  | —      | < 3.3% > |                |           |
| (イギリス)                              |         |     | 千英ポンド  |          |                |           |
| ANTOFAGASTA PLC                     | 54      | 54  | 43     | 5,780    | 金属・鉱業          |           |
| ASHTREAD GROUP PLC                  | 59      | 59  | 130    | 17,369   | 商社・流通業         |           |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC            | 105     | 105 | 55     | 7,404    | 家庭用耐久財         |           |
| AVIVA PLC                           | 441     | 441 | 109    | 14,488   | 保険             |           |
| DIAGEO PLC                          | 270     | 274 | 761    | 101,121  | 飲料             |           |
| SCHRODERS PLC                       | 11      | 11  | 30     | 4,078    | 資本市場           |           |
| DCC PLC                             | 13      | 13  | 79     | 10,529   | ロングロマリット       |           |

| 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      |                |
| BAE SYSTEMS PLC                 | 352     | 400   | 204   | 27,218  | 航空宇宙・防衛        |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC    | 265     | 269   | 800   | 106,388 | タバコ            |
| HALMA PLC                       | —       | 38    | 84    | 11,272  | 電子装置・機器・部品     |
| STANDARD CHARTERED PLC          | 295     | 300   | 124   | 16,476  | 銀行             |
| IMPERIAL BRANDS PLC             | 103     | 121   | 196   | 26,153  | タバコ            |
| HSBC HOLDINGS PLC               | 2,243   | 2,360 | 973   | 129,392 | 銀行             |
| LEGAL & GENERAL                 | 630     | 620   | 127   | 16,885  | 保険             |
| MEGGITT PLC                     | 110     | 110   | 28    | 3,765   | 航空宇宙・防衛        |
| MORRISON SUPERMARKETS           | 200     | 200   | 37    | 4,971   | 食品・生活必需品小売り    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC    | 47      | 47    | 83    | 11,026  | 食品             |
| PEARSON                         | 88      | 88    | 39    | 5,256   | メディア           |
| PERSIMMON PLC                   | 42      | 42    | 95    | 12,732  | 家庭用耐久財         |
| PRUDENTIAL PLC                  | 287     | 307   | 344   | 45,801  | 保険             |
| RIO TINTO PLC-REG               | 129     | 129   | 480   | 63,846  | 金属・鉱業          |
| ST JAMES S PLACE PLC            | 62      | 62    | 52    | 6,994   | 資本市場           |
| SSE PLC                         | 137     | 108   | 133   | 17,726  | 電力             |
| BP PLC                          | 2,240   | 2,370 | 748   | 99,462  | 石油・ガス・消耗燃料     |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 8,200   | 8,200 | 256   | 34,080  | 銀行             |
| TAYLOR WIMPEY PLC               | 343     | 343   | 52    | 6,921   | 家庭用耐久財         |
| TESCO PLC                       | 1,060   | 1,040 | 246   | 32,786  | 食品・生活必需品小売り    |
| SMITH & NEPHEW PLC              | 89      | 112   | 185   | 24,662  | ヘルスケア機器・用品     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC             | 575     | 581   | 972   | 129,255 | 医薬品            |
| WEIR GROUP PLC                  | 28      | 28    | 26    | 3,580   | 機械             |
| BABCOCK INTL GROUP PLC          | 33      | —     | —     | —       | 商業サービス・用品      |
| ASTRAZENECA PLC                 | 147     | 152   | 1,306 | 173,515 | 医薬品            |
| BT GROUP PLC                    | 990     | 990   | 103   | 13,803  | 各種電気通信サービス     |
| CARNIVAL PLC                    | 17      | 17    | 15    | 2,116   | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER PLC             | 172     | 206   | 19    | 2,608   | 複合小売り          |
| BARCLAYS PLC                    | 1,870   | 2,140 | 225   | 29,970  | 銀行             |
| INTERTEK GROUP PLC              | 22      | 15    | 70    | 9,409   | 専門サービス         |
| BURBERRY GROUP PLC              | 48      | 48    | 66    | 8,831   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEXT PLC                        | 18      | 18    | 87    | 11,674  | 複合小売り          |
| KINGFISHER PLC                  | 250     | 250   | 39    | 5,186   | 専門小売り          |
| ITV PLC                         | 410     | 410   | 30    | 3,993   | メディア           |
| SAINSBURY                       | 180     | 180   | 34    | 4,608   | 食品・生活必需品小売り    |
| G4S PLC                         | 161     | 161   | 15    | 2,073   | 商業サービス・用品      |
| ADMIRAL GROUP PLC               | 15      | 29    | 70    | 9,304   | 保険             |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS       | 14      | 14    | 59    | 7,938   | 家庭用耐久財         |
| CENTRICA PLC                    | 550     | 550   | 21    | 2,916   | 総合公益事業         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 509     | 484   | 639   | 84,913  | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B         | 435     | 438   | 553   | 73,526  | 石油・ガス・消耗燃料     |
| BUNZLE                          | 44      | 44    | 76    | 10,115  | 商社・流通業         |
| RENTOKIL INTIAL PLC             | —       | 180   | 86    | 11,528  | 商業サービス・用品      |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 36      | 36    | 281   | 37,438  | 資本市場           |
| UNILEVER PLC                    | 123     | 130   | 530   | 70,515  | パーソナル用品        |
| TUI AG-DI                       | 54      | 54    | 14    | 1,901   | ホテル・レストラン・レジャー |
| INVESTEC PLC                    | 62      | —     | —     | —       | 資本市場           |
| EXPERIAN PLC                    | 104     | 104   | 270   | 35,936  | 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 |                         |
| (イギリス)                            | 百株      | 百株    | 千英ポンド | 千円     |                         |
| MONDI PLC                         | 39      | 54    | 73    | 9,763  | 紙製品・林産品                 |
| SEVERN TRENT PLC                  | 27      | 27    | 65    | 8,669  | 水道                      |
| WHITBREAD PLC                     | 23      | 16    | 45    | 6,074  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC           | 36      | 36    | 54    | 7,197  | 資本市場                    |
| SMITHS GROUP PLC                  | 47      | 47    | 58    | 7,804  | コングロマリット                |
| ANGLO AMERICAN PLC                | 113     | 110   | 161   | 21,438 | 金属・鉱業                   |
| 3I GROUP PLC                      | 124     | 124   | 94    | 12,602 | 資本市場                    |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 79      | 83    | 552   | 73,392 | 家庭用品                    |
| RELX PLC                          | 229     | 232   | 431   | 57,296 | 専門サービス                  |
| FRESNILLO PLC                     | 27      | —     | —     | —      | 金属・鉱業                   |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC        | 73      | 73    | 65    | 8,724  | 水道                      |
| OCADO GROUP PLC                   | —       | 43    | 80    | 10,648 | インターネット販売・通信販売          |
| GLENCORE PLC                      | 1,240   | 1,220 | 180   | 24,016 | 金属・鉱業                   |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC             | 65      | —     | —     | —      | エネルギー設備・サービス            |
| GVC HOLDINGS PLC                  | 58      | 58    | 45    | 6,108  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          | 190     | 190   | 54    | 7,246  | 航空宇宙・防衛                 |
| EVRAZ PLC                         | —       | 40    | 10    | 1,434  | 金属・鉱業                   |
| NMC HEALTH PLC                    | 8       | 8     | 1     | 249    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EASYJET PLC                       | 19      | 19    | 10    | 1,341  | 旅客航空輸送業                 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP      | 570     | 570   | 65    | 8,640  | 銀行                      |
| SAGE GROUP PLC (THE)              | 135     | 135   | 86    | 11,514 | ソフトウェア                  |
| WPP PLC                           | 132     | 131   | 79    | 10,529 | メディア                    |
| COCA-COLA HBC AG-DI               | 19      | 19    | 36    | 4,787  | 飲料                      |
| AVEVA GROUP PLC                   | —       | 5     | 19    | 2,597  | ソフトウェア                  |
| CONVATEC GROUP PLC-WI             | 90      | —     | —     | —      | ヘルスケア機器・用品              |
| COMPASS GROUP PLC                 | 173     | 196   | 252   | 33,511 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| NATIONAL GRID PLC                 | 372     | 416   | 383   | 50,910 | 総合公益事業                  |
| ROYAL MAIL PLC                    | 121     | —     | —     | —      | 航空貨物・物流サービス             |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI      | 62      | —     | —     | —      | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC        | 234     | 234   | 51    | 6,837  | 資本市場                    |
| FERGUSON PLC                      | 25      | —     | —     | —      | 商社・流通業                  |
| BHP GROUP PLC                     | 251     | 255   | 351   | 46,634 | 金属・鉱業                   |
| VODAFONE GROUP PLC                | 3,150   | 3,150 | 355   | 47,254 | 無線通信サービス                |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 24      | 23    | 82    | 10,981 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C       | 13,490  | —     | —     | —      | 航空宇宙・防衛                 |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC     | 32      | 32    | 15    | 2,049  | ソフトウェア                  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           | 14      | 14    | 72    | 9,658  | 化学                      |
| FERGUSON PLC                      | —       | 25    | 145   | 19,294 | 商社・流通業                  |
| M&G PLC                           | —       | 312   | 41    | 5,454  | 各種金融サービス                |
| RSA INSURANCE GROUP PLC           | 121     | 121   | 47    | 6,327  | 保険                      |
| INFORMA PLC                       | 130     | 127   | 57    | 7,664  | メディア                    |
| AUTO TRADER GROUP PLC             | 130     | 130   | 62    | 8,286  | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      | —       | 7     | 67    | 8,962  | 機械                      |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC         | —       | 7     | 76    | 10,206 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       | 120     | 120   | 33    | 4,473  | 保険                      |
| JD SPORTS FASHION PLC             | —       | 36    | 19    | 2,650  | 専門小売り                   |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | 560     | 560   | 53    | 7,142  | 電気設備                    |

| 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      |                   |  |
| JOHNSON MATTHEY PLC              |   | 26            | 26     | 50          | 6,752   | 化学                |  |
| 小                                | 計 | 株 数 ・ 金 額     | 47,123 | 34,517      | 16,623  | 2,208,389         |  |
|                                  |   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 93     | 94          | —       | <4.8%>            |  |
| (スイス)                            |   |               |        | 千スイスフラン     |         |                   |  |
| SGS SA-REG                       |   | 0.57          | 0.67   | 146         | 16,095  | 専門サービス            |  |
| BARRY CALLEBAUT AG               |   | 0.22          | 0.39   | 72          | 7,959   | 食品                |  |
| SWISSCOM AG-REG                  |   | 2             | 3      | 170         | 18,734  | 各種電気通信サービス        |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC       |   | 0.14          | 0.14   | 109         | 12,080  | 食品                |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG      |   | 0.01          | 0.01   | 81          | 9,014   | 食品                |  |
| GIVAUDAN-REG                     |   | 1             | 0.99   | 328         | 36,242  | 化学                |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG        |   | 16            | 17     | 518         | 57,140  | 保険                |  |
| NOVARTIS AG-REG                  |   | 246           | 251    | 2,076       | 228,813 | 医薬品               |  |
| ABB LTD                          |   | 221           | 222    | 394         | 43,448  | 電気設備              |  |
| ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)    |   | 79            | 81     | 2,791       | 307,615 | 医薬品               |  |
| ADECCO GROUP AG-REG              |   | 19            | 19     | 79          | 8,764   | 専門サービス            |  |
| LAFARGEHOLCIM LTD                |   | 57            | 57     | 226         | 24,905  | 建設資材              |  |
| CLARIANT AG-REG                  |   | 22            | 22     | 39          | 4,336   | 化学                |  |
| NESTLE SA-REG                    |   | 348           | 346    | 3,640       | 401,166 | 食品                |  |
| BALOISE HOLDING AG               |   | 5             | 5      | 80          | 8,871   | 保険                |  |
| TEMENOS AG-REG                   |   | 7             | 7      | 101         | 11,204  | ソフトウェア            |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG            |   | 6             | 6      | 128         | 14,196  | ヘルスケア機器・用品        |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG         |   | 1             | 1      | 74          | 8,198   | ヘルスケア機器・用品        |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG       |   | 278           | 289    | 235         | 25,968  | 資本市場              |  |
| THE SWATCH GROUP AG-B            |   | 3             | 3      | 63          | 7,012   | 繊維・アパレル・贅沢品       |  |
| THE SWATCH GROUP AG-REG          |   | 5             | 5      | 19          | 2,197   | 繊維・アパレル・贅沢品       |  |
| LONZA AG-REG                     |   | 8             | 8      | 374         | 41,266  | ライフサイエンス・ツール/サービス |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG            |   | 3             | 3      | 129         | 14,311  | 保険                |  |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG        |   | 0.7           | 0.7    | 44          | 4,925   | 化学                |  |
| SWISS PRIME SITE-REG             |   | 7             | 7      | 74          | 8,168   | 不動産管理・開発          |  |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES |   | 2             | 2      | 19          | 2,124   | 各種金融サービス          |  |
| DUFREY AG-REG                    |   | 2             | 2      | 7           | 853     | 専門小売り             |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG        |   | 1             | 2      | 189         | 20,851  | 資本市場              |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT      |   | 3             | 3      | 79          | 8,733   | 機械                |  |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG         |   | 3             | 3      | 67          | 7,405   | 機械                |  |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG       |   | 6             | 6      | 86          | 9,497   | 海運業               |  |
| GEBERIT AG-REG                   |   | 3             | 3      | 164         | 18,119  | 建設関連製品            |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD            |   | 25            | 25     | 93          | 10,353  | 資本市場              |  |
| SWISS RE LTD                     |   | 34            | 34     | 230         | 25,390  | 保険                |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A    |   | 59            | 56     | 312         | 34,410  | 繊維・アパレル・贅沢品       |  |
| SIKA AG-REG                      |   | 15            | 15     | 255         | 28,115  | 化学                |  |
| ALCON INC                        |   | 49            | 49     | 259         | 28,573  | ヘルスケア機器・用品        |  |
| UBS GROUP AG                     |   | 455           | 455    | 437         | 48,225  | 資本市場              |  |
| VIFOR PHARMA AG                  |   | 5             | 5      | 90          | 9,938   | 医薬品               |  |
| 小                                | 計 | 株 数 ・ 金 額     | 2,011  | 2,029       | 14,294  | 1,575,231         |  |
|                                  |   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 39     | 39          | —       | <3.4%>            |  |
| (スウェーデン)                         |   |               |        | 千スウェーデンクローナ |         |                   |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS               |   | 8             | 8      | 334         | 3,653   | 各種金融サービス          |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB |   | 184           | 184    | 1,386       | 15,145  | 銀行                |  |

| 銘柄                                  | 株数      | 期首(前期末) |             | 当期         |             | 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         |             |     |
| SWEDBANK AB                         | 118     | 96      | 1,039       | 11,353     | 銀行          |     |
| SWEDISH MATCH AB                    | 19      | 19      | 1,178       | 12,867     | タバコ         |     |
| SECURITAS AB-B SHS                  | 43      | 43      | 516         | 5,634      | 商業サービス・用品   |     |
| INVESTOR AB-B SHS                   | 49      | 55      | 2,659       | 29,045     | 各種金融サービス    |     |
| HENNES&MAURITZ AB-B                 | 100     | 105     | 1,390       | 15,186     | 専門小売り       |     |
| ERICSSON LM-B                       | 370     | 370     | 3,093       | 33,785     | 通信機器        |     |
| TELIA CO AB                         | 320     | 320     | 1,046       | 11,426     | 各種電気通信サービス  |     |
| SKANSKA AB-B SHS                    | 23      | 47      | 868         | 9,479      | 建設・土木       |     |
| LUNDIN ENERGY AB                    | 25      | 25      | 565         | 6,175      | 石油・ガス・消耗燃料  |     |
| ALFA LAVAL AB                       | 30      | 30      | 561         | 6,126      | 機械          |     |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR | 5       | 9       | 232         | 2,540      | 無線通信サービス    |     |
| ICA GRUPPEN AB                      | 9       | 9       | 374         | 4,087      | 食品・生活必需品小売り |     |
| HUSQVARNA AB-B SHS                  | 46      | 46      | 268         | 2,928      | 家庭用耐久財      |     |
| ELECTROLUX AB-B                     | 26      | 26      | 358         | 3,916      | 家庭用耐久財      |     |
| SKF AB-B SHARES                     | 46      | 46      | 720         | 7,871      | 機械          |     |
| VOLVO AB-B SHS                      | 164     | 165     | 2,089       | 22,819     | 機械          |     |
| SANDVIK AB                          | 128     | 128     | 1,920       | 20,966     | 機械          |     |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS             | 20      | 20      | 406         | 4,433      | 各種金融サービス    |     |
| HEXAGON AB-B SHS                    | 30      | 30      | 1,418       | 15,492     | 電子装置・機器・部品  |     |
| TELE 2 AB-B SHS                     | 71      | 69      | 875         | 9,561      | 無線通信サービス    |     |
| KINNEVIK AB - B                     | 23      | —       | —           | —          | 各種金融サービス    |     |
| ATLAS COPCO AB-A                    | 84      | 75      | 2,584       | 28,222     | 機械          |     |
| ATLAS COPCO AB-B                    | 48      | 48      | 1,497       | 16,353     | 機械          |     |
| BOLIDEN AB                          | 26      | —       | —           | —          | 金属・鉱業       |     |
| EPIROC AB - A                       | 69      | 69      | 699         | 7,636      | 機械          |     |
| EPIROC AB - B                       | 35      | 35      | 354         | 3,875      | 機械          |     |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B                 | 61      | 74      | 2,313       | 25,260     | 家庭用品        |     |
| BOLIDEN AB                          | —       | 26      | 517         | 5,650      | 金属・鉱業       |     |
| KINNEVIK AB - B                     | —       | 34      | 751         | 8,205      | 各種金融サービス    |     |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A             | 171     | 171     | 1,495       | 16,327     | 銀行          |     |
| ASSA ABLOY AB-B                     | 123     | 106     | 1,986       | 21,697     | 建設関連製品      |     |
| NORDEA BANK ABP                     | 335     | 400     | 2,384       | 26,033     | 銀行          |     |
| 小計                                  | 株数・金額   | 2,809   | 2,888       | 37,890     | 413,761     |     |
|                                     | 銘柄数<比率> | 32      | 32          | —          | <0.9%>      |     |
| (ノルウェー)                             |         |         |             | 千ノルウェークローネ |             |     |
| DNB ASA                             | 102     | 117     | 1,381       | 14,425     | 銀行          |     |
| TELENOR ASA                         | 87      | 82      | 1,232       | 12,871     | 各種電気通信サービス  |     |
| EQUINOR ASA                         | 129     | 115     | 1,618       | 16,898     | 石油・ガス・消耗燃料  |     |
| YARA INTERNATIONAL ASA              | 23      | 23      | 775         | 8,094      | 化学          |     |
| MOWI ASA                            | 48      | 50      | 900         | 9,396      | 食品          |     |
| NORSK HYDRO                         | 142     | 142     | 342         | 3,572      | 金属・鉱業       |     |
| AKER AB ASA                         | 10      | 10      | 174         | 1,825      | 石油・ガス・消耗燃料  |     |
| ORKLA ASA                           | 102     | 82      | 695         | 7,264      | 食品          |     |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA           | 26      | 26      | 462         | 4,828      | 保険          |     |
| SCHIBSTED ASA-B SHS                 | 9       | 9       | 192         | 2,005      | メディア        |     |
| 小計                                  | 株数・金額   | 678     | 656         | 7,776      | 81,182      |     |
|                                     | 銘柄数<比率> | 10      | 10          | —          | <0.2%>      |     |

| 銘柄                           | 株数      | 当期   |       | 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                      |     |
| CARLSBERG B                  | 10      | 12   | 1,053 | 16,387     | 飲料                      |     |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 0.79    | 0.79 | 500   | 7,788      | 海運業                     |     |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A    | 0.51    | 0.51 | 301   | 4,686      | 海運業                     |     |
| DANSKE BANK AS               | 72      | 72   | 556   | 8,650      | 銀行                      |     |
| GENMAB A/S                   | 7       | 7    | 1,419 | 22,074     | バイオテクノロジー               |     |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 23      | 19   | 1,175 | 18,276     | 電気設備                    |     |
| H LUNDBECK A/S               | 7       | 7    | 169   | 2,640      | 医薬品                     |     |
| DSV PANALPINA A S            | 22      | 23   | 1,627 | 25,302     | 航空貨物・物流サービス             |     |
| PANDORA A/S                  | 12      | 12   | 350   | 5,456      | 繊維・アパレル・贅沢品             |     |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | 10      | 12   | 733   | 11,401     | 化学                      |     |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 25      | 25   | 873   | 13,582     | 化学                      |     |
| COLOPLAST-B                  | 12      | 12   | 1,357 | 21,102     | ヘルスケア機器・用品              |     |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 204     | 208  | 8,985 | 139,726    | 医薬品                     |     |
| ISS A/S                      | 19      | 19   | 192   | 2,994      | 商業サービス・用品               |     |
| TRYG A/S                     | 10      | 10   | 182   | 2,837      | 保険                      |     |
| ORSTED A/S                   | 23      | 23   | 1,628 | 25,325     | 電力                      |     |
| DEMANT A/S                   | 13      | 13   | 223   | 3,472      | ヘルスケア機器・用品              |     |
| 小計                           | 株数・金額   | 474  | 480   | 21,331     | 331,706                 |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 17   | 17    | —          | <0.7%>                  |     |
| (ユーロ…ドイツ)                    |         |      |       | 千ユーロ       |                         |     |
| ADIDAS AG                    | 19      | 21   | 438   | 50,885     | 繊維・アパレル・贅沢品             |     |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 44      | 52   | 208   | 24,230     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 15      | 15   | 47    | 5,559      | 各種電気通信サービス              |     |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD       | 7       | 7    | 25    | 3,009      | 化学                      |     |
| HANNOVER RUECK SE            | 8       | 6    | 84    | 9,835      | 保険                      |     |
| GEA GROUP AG                 | 17      | 17   | 37    | 4,377      | 機械                      |     |
| CONTINENTAL AG               | 13      | 13   | 109   | 12,665     | 自動車部品                   |     |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 107     | 105  | 281   | 32,618     | 航空貨物・物流サービス             |     |
| AXEL SPRINGER SE             | 3       | —    | —     | —          | メディア                    |     |
| MERCK KGAA                   | 16      | 17   | 180   | 20,922     | 医薬品                     |     |
| RWE AG                       | 63      | 63   | 170   | 19,826     | 総合公益事業                  |     |
| SAP SE                       | 109     | 115  | 1,242 | 144,100    | ソフトウェア                  |     |
| E.ON SE                      | 248     | 248  | 227   | 26,386     | 総合公益事業                  |     |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 14      | 14   | 103   | 11,992     | 家庭用品                    |     |
| PUMA SE                      | 1       | 12   | 72    | 8,365      | 繊維・アパレル・贅沢品             |     |
| BAYER AG-REG                 | 107     | 116  | 672   | 78,031     | 医薬品                     |     |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 22      | 22   | 176   | 20,498     | 家庭用品                    |     |
| BASF SE                      | 106     | 105  | 485   | 56,320     | 化学                      |     |
| BEIERSDORF AG                | 12      | 12   | 120   | 13,998     | パーソナル用品                 |     |
| HOCHTIEF AG                  | 1       | 1    | 11    | 1,316      | 建設・土木                   |     |
| HEIDELBERGCEMENT AG          | 14      | 14   | 65    | 7,545      | 建設資材                    |     |
| FRESENIUS MEDICAL CARE       | 23      | 23   | 165   | 19,150     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| ALLIANZ SE-REG               | 47      | 49   | 777   | 90,174     | 保険                      |     |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 30      | 30   | 23    | 2,706      | 旅客航空輸送業                 |     |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 17      | 17   | 332   | 38,561     | 保険                      |     |
| VOLKSWAGEN AG                | 3       | 3    | 51    | 5,965      | 自動車                     |     |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 20      | 23   | 299   | 34,694     | 自動車                     |     |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 107     | 107  | 338   | 39,290     | 自動車                     |     |

| 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     |                    |  |
| THYSSENKRUPP AG                   | 48            | 48    | 25    | 2,939  | 金属・鉱業              |  |
| SIEMENS AG                        | 88            | 90    | 800   | 92,831 | コングロマリット           |  |
| I&I DRILLISCH AG                  | 5             | —     | —     | —      | 無線通信サービス           |  |
| DEUTSCHE BANK AG-REG              | 204           | 223   | 145   | 16,909 | 資本市場               |  |
| BAYER MOTOREN WERK                | 35            | 36    | 185   | 21,472 | 自動車                |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD      | 7             | 7     | 32    | 3,745  | 自動車                |  |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG              | 393           | 395   | 539   | 62,590 | 各種電気通信サービス         |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG               | 3             | 3     | 91    | 10,631 | ヘルスケア機器・用品         |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 121           | 158   | 289   | 33,558 | 半導体・半導体製造装置        |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR          | —             | 3     | 37    | 4,311  | ヘルスケア機器・用品         |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 20            | 23    | 343   | 39,805 | 資本市場               |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE      | 16            | 16    | 75    | 8,723  | 自動車                |  |
| FRAPORT AG                        | 3             | 3     | 14    | 1,664  | 運送インフラ             |  |
| WIRECARD AG                       | 13            | 13    | 113   | 13,182 | 情報技術サービス           |  |
| LANXESS                           | 9             | 9     | 45    | 5,267  | 化学                 |  |
| MTU AERO ENGINES AG               | 5             | 5     | 68    | 7,923  | 航空宇宙・防衛            |  |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                | 42            | 42    | 161   | 18,703 | 不動産管理・開発           |  |
| SYMRISE AG                        | 15            | 15    | 145   | 16,878 | 化学                 |  |
| BRENTTAG AG                       | 19            | 19    | 84    | 9,812  | 商社・流通業             |  |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 18            | 18    | 40    | 4,668  | 化学                 |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 50            | 50    | 13    | 1,590  | 各種電気通信サービス         |  |
| HUGO BOSS AG                      | 7             | —     | —     | —      | 繊維・アパレル・贅沢品        |  |
| COMMERZBANK AG                    | 114           | 114   | 36    | 4,289  | 銀行                 |  |
| OSRAM LICHT AG                    | 8             | —     | —     | —      | 電気設備               |  |
| KION GROUP AG                     | 9             | 9     | 44    | 5,171  | 機械                 |  |
| VONOVIA SE                        | 57            | 57    | 277   | 32,134 | 不動産管理・開発           |  |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE          | 27            | —     | —     | —      | メディア               |  |
| KNORR-BREMSE AG                   | —             | 4     | 39    | 4,623  | 機械                 |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG           | 16            | 16    | 65    | 7,579  | ヘルスケア機器・用品         |  |
| METRO AG                          | 17            | 17    | 12    | 1,502  | 食品・生活必需品小売り        |  |
| INNOGY SE                         | 16            | —     | —     | —      | 総合公益事業             |  |
| ZALANDO SE                        | 9             | 18    | 96    | 11,149 | インターネット販売・通信販売     |  |
| COVESTRO AG                       | 22            | 22    | 69    | 8,052  | 化学                 |  |
| QIAGEN NV                         | 21            | 21    | 85    | 9,957  | ライフサイエンス・ツール/サービス  |  |
| UNIPER SE                         | 21            | 21    | 52    | 6,143  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |  |
| DELIVERY HERO SE                  | 8             | 10    | 87    | 10,140 | インターネット販売・通信販売     |  |
| 小 計                               | 株 数           | 2,675 | 2,726 | 10,870 | 1,260,988          |  |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 62    | 58    | —      | < 2.8% >           |  |
| (ユーロ…イタリア)                        |               |       |       |        |                    |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI            | 123           | 123   | 159   | 18,512 | 保険                 |  |
| INTESA SANPAOLO                   | 1,680         | 1,760 | 248   | 28,868 | 銀行                 |  |
| MEDIOBANCA S. P. A.               | 56            | 86    | 44    | 5,183  | 銀行                 |  |
| ENEL SPA                          | 910           | 950   | 589   | 68,324 | 電力                 |  |
| ENI SPA                           | 289           | 287   | 247   | 28,734 | 石油・ガス・消耗燃料         |  |
| SNAM SPA                          | 310           | 230   | 92    | 10,741 | ガス                 |  |
| TENARIS SA                        | 54            | 54    | 33    | 3,902  | エネルギー設備・サービス       |  |
| TELECOM ITALIA SPA                | 1,120         | 1,120 | 38    | 4,495  | 各種電気通信サービス         |  |
| TELECOM ITALIA-RNC                | 680           | 680   | 23    | 2,752  | 各種電気通信サービス         |  |

| 銘柄                                  | 株数               | 当期          |             |            |                   | 業種等 |
|-------------------------------------|------------------|-------------|-------------|------------|-------------------|-----|
|                                     |                  | 株数          | 評価額         |            | 業種等               |     |
|                                     |                  |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |                   |     |
| (ユーロ…イタリア)                          | 百株               | 百株          | 千ユーロ        | 千円         |                   |     |
| ATLANTIA SPA                        | 53               | 53          | 73          | 8,576      | 運送インフラ            |     |
| TERNA SPA                           | 180              | 180         | 103         | 12,060     | 電力                |     |
| RECORDATI SPA                       | 11               | 11          | 45          | 5,282      | 医薬品               |     |
| LEONARDO SPA                        | 42               | 42          | 25          | 2,971      | 航空宇宙・防衛           |     |
| PRYSMIAN SPA                        | 28               | 28          | 50          | 5,891      | 電気設備              |     |
| FERRARI NV                          | 14               | 14          | 210         | 24,463     | 自動車               |     |
| CNH INDUSTRIAL NV                   | 134              | 136         | 70          | 8,156      | 機械                |     |
| MONCLER SPA                         | 17               | 17          | 55          | 6,464      | 繊維・アパレル・贅沢品       |     |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA         | —                | 56          | 54          | 6,286      | 銀行                |     |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV        | 134              | 134         | 104         | 12,077     | 自動車               |     |
| UNICREDIT SPA                       | 214              | 240         | 157         | 18,318     | 銀行                |     |
| EXOR NV                             | 13               | 13          | 63          | 7,313      | 各種金融サービス          |     |
| POSTE ITALIANE SPA                  | 73               | 76          | 56          | 6,522      | 保険                |     |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA           | 55               | 55          | 39          | 4,589      | 飲料                |     |
| PIRELLI & C. SPA                    | 35               | 35          | 12          | 1,489      | 自動車部品             |     |
| 小計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 6,225<br>23 | 6,380<br>24 | 2,603<br>— | 301,979<br><0.7%> |     |
| (ユーロ…フランス)                          |                  |             |             |            |                   |     |
| BOUYGUES                            | 21               | 21          | 58          | 6,821      | 建設・土木             |     |
| AIRBUS SE                           | 66               | 70          | 394         | 45,723     | 航空宇宙・防衛           |     |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 52               | 70          | 137         | 15,943     | 総合公益事業            |     |
| LOREAL-ORD                          | 28               | 29          | 745         | 86,453     | パーソナル用品           |     |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 32               | 32          | 1,134       | 131,572    | 繊維・アパレル・贅沢品       |     |
| DASSAULT AVIATION SA                | 0.26             | 0.26        | 18          | 2,179      | 航空宇宙・防衛           |     |
| THALES SA                           | 13               | 13          | 95          | 11,030     | 航空宇宙・防衛           |     |
| CAPGEMINI SA                        | 19               | 19          | 176         | 20,432     | 情報技術サービス          |     |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA        | 7                | 7           | 24          | 2,866      | 食品・生活必需品小売り       |     |
| INGENICO GROUP                      | 6                | 6           | 85          | 9,884      | 電子装置・機器・部品        |     |
| PUBLICIS GROUPE                     | 27               | 27          | 70          | 8,218      | メディア              |     |
| FAURECIA                            | 7                | 7           | 24          | 2,862      | 自動車部品             |     |
| BOLLORE                             | 75               | 75          | 18          | 2,201      | 娯楽                |     |
| MICHELIN (CGDE)                     | 19               | 19          | 177         | 20,609     | 自動車部品             |     |
| PERNOD RICARD SA                    | 24               | 24          | 334         | 38,850     | 飲料                |     |
| RENAULT SA                          | 20               | 20          | 35          | 4,106      | 自動車               |     |
| REMY COINTREAU                      | 1                | 1           | 14          | 1,628      | 飲料                |     |
| SEB SA                              | 2                | 2           | 29          | 3,377      | 家庭用耐久財            |     |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 65               | 65          | 529         | 61,476     | 電気設備              |     |
| VIVENDI SA                          | 113              | 92          | 183         | 21,301     | 娯楽                |     |
| ORANGE SA                           | 217              | 209         | 224         | 26,001     | 各種電気通信サービス        |     |
| HERMES INTERNATIONAL                | 3                | 4           | 271         | 31,542     | 繊維・アパレル・贅沢品       |     |
| SOCIETE BIC SA                      | 3                | —           | —           | —          | 商業サービス・用品         |     |
| DASSAULT SYSTEMES SA                | 14               | 14          | 197         | 22,955     | ソフトウェア            |     |
| KERING SA                           | 8                | 8           | 393         | 45,680     | 繊維・アパレル・贅沢品       |     |
| CNP ASSURANCES                      | 16               | 16          | 15          | 1,752      | 保険                |     |
| CARREFOUR SUPERMARCHE               | 76               | 76          | 101         | 11,720     | 食品・生活必需品小売り       |     |
| ATOS SE                             | 8                | 8           | 58          | 6,828      | 情報技術サービス          |     |
| SANOFI                              | 130              | 132         | 1,182       | 137,149    | 医薬品               |     |
| ACCOR SA                            | 21               | 21          | 48          | 5,595      | ホテル・レストラン・レジャー    |     |

| 銘柄                         | 株数      | 当期    |       | 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…フランス)                 | 百株      | 百株    | 千ユーロ  | 千円      |           |                   |
| STMICROELECTRONICS NV      | 80      | 80    | 187   | 21,696  |           | 半導体・半導体製造装置       |
| SOCIETE GENERALE           | 80      | 97    | 128   | 14,929  |           | 銀行                |
| TELEPERFORMANCE            | 5       | 5     | 132   | 15,405  |           | 専門サービス            |
| EURAZEO SE                 | 3       | 3     | 15    | 1,798   |           | 各種金融サービス          |
| SODEXO                     | 11      | 11    | 72    | 8,428   |           | ホテル・レストラン・レジャー    |
| AXA                        | 229     | 228   | 369   | 42,914  |           | 保険                |
| PEUGEOT CITROEN            | 69      | 69    | 92    | 10,745  |           | 自動車               |
| JC DECAUX SA               | 7       | 7     | 14    | 1,661   |           | メディア              |
| ESSILORLUXOTTICA           | 33      | 33    | 369   | 42,812  |           | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| CREDIT AGRICOLE SA         | 144     | 144   | 104   | 12,127  |           | 銀行                |
| BNP PARIBAS                | 128     | 128   | 368   | 42,784  |           | 銀行                |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) | 55      | 55    | 139   | 16,205  |           | 建設関連製品            |
| WENDEL                     | 2       | 2     | 19    | 2,266   |           | 各種金融サービス          |
| ILIAD SA                   | 3       | 3     | 44    | 5,153   |           | 各種電気通信サービス        |
| SES FDR                    | 39      | 39    | 23    | 2,777   |           | メディア              |
| IMERYS                     | 4       | —     | —     | —       |           | 建設資材              |
| SAFRAN SA                  | 36      | 37    | 301   | 35,004  |           | 航空宇宙・防衛           |
| ENGIE                      | 198     | 226   | 221   | 25,686  |           | 総合公益事業            |
| ALSTOM                     | 21      | 21    | 76    | 8,847   |           | 機械                |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS    | 22      | 22    | 20    | 2,354   |           | メディア              |
| ELECTRICITE DE FRANCE      | 74      | 74    | 53    | 6,180   |           | 電力                |
| IPSEN                      | 5       | 5     | 35    | 4,131   |           | 医薬品               |
| ARKEMA                     | 8       | 8     | 64    | 7,473   |           | 化学                |
| LEGRAND SA                 | 28      | 29    | 173   | 20,150  |           | 電気設備              |
| EIFFAGE SA                 | 9       | 9     | 72    | 8,375   |           | 建設・土木             |
| TOTAL SA                   | 278     | 282   | 930   | 107,900 |           | 石油・ガス・消耗燃料        |
| ADP                        | 2       | 2     | 23    | 2,724   |           | 運送インフラ            |
| NATIXIS                    | 110     | 110   | 23    | 2,774   |           | 資本市場              |
| UBISOFT ENTERTAINMENT      | 9       | 9     | 67    | 7,886   |           | 娯楽                |
| SCOR SE                    | 22      | 22    | 53    | 6,175   |           | 保険                |
| REXEL SA                   | 41      | —     | —     | —       |           | 商社・流通業            |
| VINCI                      | 60      | 61    | 472   | 54,789  |           | 建設・土木             |
| DANONE                     | 67      | 73    | 467   | 54,246  |           | 食品                |
| AIR LIQUIDE SA             | 47      | 56    | 672   | 78,026  |           | 化学                |
| BUREAU VERITAS SA          | 31      | 31    | 58    | 6,737   |           | 専門サービス            |
| GETLINK                    | 63      | 63    | 71    | 8,331   |           | 運送インフラ            |
| SUEZ                       | 36      | 36    | 37    | 4,303   |           | 総合公益事業            |
| EDENRED                    | 29      | 29    | 114   | 13,264  |           | 情報技術サービス          |
| VALEO SA                   | 24      | 24    | 49    | 5,762   |           | 自動車部品             |
| BIOMERIEUX                 | 4       | 4     | 50    | 5,890   |           | ヘルスケア機器・用品        |
| WORLDLINE SA               | 3       | 12    | 79    | 9,206   |           | 情報技術サービス          |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH   | 2       | 2     | 51    | 6,022   |           | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AMUNDI SA                  | 6       | 6     | 36    | 4,176   |           | 資本市場              |
| 小計                         | 株数・金額   | 3,238 | 3,260 | 13,145  | 1,524,898 |                   |
|                            | 銘柄数<比率> | 73    | 70    | —       | <3.3%>    |                   |
| (ユーロ…オランダ)                 |         |       |       |         |           |                   |
| RANDSTAD NV                | 15      | 15    | 54    | 6,326   |           | 専門サービス            |
| WOLTERS KLUWER             | 35      | 30    | 202   | 23,483  |           | 専門サービス            |

| 銘柄                                   | 株数      | 当期    |       |         |                | 業種等 |
|--------------------------------------|---------|-------|-------|---------|----------------|-----|
|                                      |         | 株数    | 評価額   |         | 業種等            |     |
|                                      |         |       | 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      |                |     |
| VOPAK                                | 7       | 7     | 34    | 4,049   | 石油・ガス・消耗燃料     |     |
| AEGON NV                             | 180     | 180   | 39    | 4,591   | 保険             |     |
| KONINKLIJKE KPN NV                   | 390     | 390   | 82    | 9,572   | 各種電気通信サービス     |     |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV               | 101     | 101   | 399   | 46,395  | ヘルスケア機器・用品     |     |
| HEINEKEN NV                          | 31      | 28    | 213   | 24,708  | 飲料             |     |
| HEINEKEN HOLDING NV                  | 12      | 12    | 90    | 10,467  | 飲料             |     |
| KONINKLIJKE DSM NV                   | 18      | 22    | 252   | 29,322  | 化学             |     |
| UNILEVER NV-CVA                      | 171     | —     | —     | —       | パーソナル用品        |     |
| UNILEVER NV                          | —       | 173   | 778   | 90,306  | パーソナル用品        |     |
| ASML HOLDING NV                      | 47      | 49    | 1,389 | 161,149 | 半導体・半導体製造装置    |     |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV        | 127     | 131   | 296   | 34,403  | 食品・生活必需品小売り    |     |
| AKZO NOBEL                           | 27      | 26    | 183   | 21,329  | 化学             |     |
| PROSUS NV                            | —       | 57    | 419   | 48,664  | インターネット販売・通信販売 |     |
| NN GROUP NV                          | 37      | 37    | 95    | 11,051  | 保険             |     |
| ARCELORMITTAL                        | 80      | 80    | 82    | 9,552   | 金属・鉱業          |     |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV             | —       | 13    | 127   | 14,790  | インターネット販売・通信販売 |     |
| ABN AMRO BANK NV-CVA                 | 44      | 44    | 29    | 3,479   | 銀行             |     |
| ALTICE EUROPE N.V.                   | —       | 50    | 18    | 2,169   | メディア           |     |
| ADYEN NV                             | 1       | 1     | 107   | 12,517  | 情報技術サービス       |     |
| ING GROEP NV                         | 458     | 482   | 244   | 28,347  | 銀行             |     |
| 小計                                   | 株数・金額   | 1,783 | 1,930 | 5,143   | 596,678        |     |
|                                      | 銘柄数<比率> | 18    | 21    | —       | <1.3%>         |     |
| (ユーロ…スペイン)                           |         |       |       |         |                |     |
| ENDESA S.A.                          | 35      | 35    | 70    | 8,233   | 電力             |     |
| BANKINTER S.A.                       | 82      | 82    | 28    | 3,342   | 銀行             |     |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | 750     | 820   | 223   | 25,939  | 銀行             |     |
| NATURGY ENERGY GROUP SA              | 42      | 33    | 54    | 6,367   | ガス             |     |
| REPSOL SA                            | 151     | 166   | 144   | 16,715  | 石油・ガス・消耗燃料     |     |
| BANCO SANTANDER SA                   | 1,880   | 1,990 | 397   | 46,121  | 銀行             |     |
| TELEFONICA SA                        | 520     | 530   | 223   | 25,913  | 各種電気通信サービス     |     |
| ENAGAS SA                            | 29      | 29    | 59    | 6,926   | ガス             |     |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA   | 18      | 18    | 24    | 2,839   | 電気設備           |     |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV         | 31      | 33    | 79    | 9,200   | 建設・土木          |     |
| FERROVIAL SA                         | 48      | 56    | 131   | 15,265  | 建設・土木          |     |
| MAPFRE SA                            | 127     | 127   | 20    | 2,380   | 保険             |     |
| BANCO DE SABADELL SA                 | 700     | 710   | 23    | 2,729   | 銀行             |     |
| CAIXABANK                            | 410     | 410   | 67    | 7,847   | 銀行             |     |
| IBERDROLA SA                         | 725     | 730   | 642   | 74,518  | 電力             |     |
| AMADEUS IT GROUP SA                  | 50      | 50    | 203   | 23,600  | 情報技術サービス       |     |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA         | 42      | 42    | 65    | 7,551   | 電力             |     |
| INDITEX SA                           | 120     | 123   | 284   | 32,987  | 専門小売り          |     |
| AENA SME SA                          | 6       | 8     | 93    | 10,889  | 運送インフラ         |     |
| CELLNEX TELECOM SA                   | —       | 26    | 133   | 15,441  | 各種電気通信サービス     |     |
| GRIFOLS SA                           | 36      | 36    | 105   | 12,202  | バイオテクノロジー      |     |
| BANKIA SA                            | 122     | 122   | 11    | 1,293   | 銀行             |     |
| 小計                                   | 株数・金額   | 5,927 | 6,179 | 3,088   | 358,308        |     |
|                                      | 銘柄数<比率> | 21    | 22    | —       | <0.8%>         |     |

| 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…ベルギー)                       |              | 百株    | 百株    | 千ユーロ  | 千円       |                   |
| KBC GROEP NV                     |              | 27    | 27    | 134   | 15,570   | 銀行                |
| SOLVAY SA                        |              | 9     | 9     | 67    | 7,871    | 化学                |
| UCB SA                           |              | 12    | 14    | 118   | 13,690   | 医薬品               |
| COLRUYT SA                       |              | 9     | 4     | 22    | 2,573    | 食品・生活必需品小売り       |
| GROUPE BRUXELLES LAM             |              | 9     | 9     | 66    | 7,746    | 各種金融サービス          |
| PROXIMUS                         |              | 15    | 15    | 28    | 3,268    | 各種電気通信サービス        |
| GALAPAGOS NV                     |              | —     | 6     | 128   | 14,951   | バイオテクノロジー         |
| TELENET GROUP HOLDING NV         |              | 6     | 6     | 24    | 2,844    | メディア              |
| AGEAS                            |              | 18    | 18    | 58    | 6,819    | 保険                |
| UMICORE                          |              | 24    | 24    | 88    | 10,292   | 化学                |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV       |              | 86    | 90    | 359   | 41,723   | 飲料                |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 217   | 224   | 1,097 | 127,352  |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 10    | 11    | —     | < 0.3% > |                   |
| (ユーロ…オーストリア)                     |              |       |       |       |          |                   |
| OMV AG                           |              | 16    | 16    | 49    | 5,742    | 石油・ガス・消耗燃料        |
| VERBUND AG                       |              | 11    | 9     | 40    | 4,662    | 電力                |
| VOESTALPINE AG                   |              | 14    | 14    | 26    | 3,078    | 金属・鉱業             |
| ERSTE GROUP BANK AG              |              | 33    | 33    | 64    | 7,506    | 銀行                |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG |              | 15    | 15    | 23    | 2,754    | 銀行                |
| ANDRITZ AG                       |              | 7     | 7     | 21    | 2,505    | 機械                |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 96    | 94    | 226   | 26,250   |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 6     | 6     | —     | < 0.1% > |                   |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)                    |              |       |       |       |          |                   |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE           |              | 1     | 1     | 73    | 8,493    | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| RTL GROUP                        |              | 3     | —     | —     | —        | メディア              |
| AROUNDTOWN SA                    |              | 116   | 116   | 58    | 6,827    | 不動産管理・開発          |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 120   | 117   | 132   | 15,320   |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 3     | 2     | —     | < 0.0% > |                   |
| (ユーロ…フィンランド)                     |              |       |       |       |          |                   |
| WARTSILA OYJ                     |              | 48    | 48    | 32    | 3,735    | 機械                |
| UPM-KYMMENE OYJ                  |              | 62    | 62    | 157   | 18,217   | 紙製品・林産品           |
| STORA ENSO OYJ-R                 |              | 61    | 61    | 64    | 7,528    | 紙製品・林産品           |
| SAMPO OYJ-A SHS                  |              | 46    | 56    | 168   | 19,526   | 保険                |
| FORTUM OYJ                       |              | 49    | 49    | 76    | 8,861    | 電力                |
| ELISA OYJ                        |              | 16    | 16    | 87    | 10,137   | 各種電気通信サービス        |
| METSO OYJ                        |              | 16    | 12    | 31    | 3,676    | 機械                |
| NOKIA OYJ                        |              | 670   | 670   | 220   | 25,604   | 通信機器              |
| NESTE OYJ                        |              | 45    | 46    | 143   | 16,691   | 石油・ガス・消耗燃料        |
| NOKIAN RENKAAT OYJ               |              | 18    | 18    | 34    | 3,983    | 自動車部品             |
| KONE OYJ                         |              | 36    | 41    | 231   | 26,823   | 機械                |
| ORION OYJ                        |              | 10    | 10    | 45    | 5,258    | 医薬品               |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 1,077 | 1,089 | 1,293 | 150,045  |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 12    | 12    | —     | < 0.3% > |                   |
| (ユーロ…アイルランド)                     |              |       |       |       |          |                   |
| CRH PLC                          |              | 98    | 97    | 262   | 30,470   | 建設資材              |
| KINGSPAN GROUP PLC               |              | 17    | 17    | 84    | 9,761    | 建設関連製品            |
| KERRY GROUP PLC-A                |              | 18    | 18    | 184   | 21,428   | 食品                |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD   |              | 134   | 134   | —     | —        | 銀行                |

| 銘柄                                     | 株数      | 当 期 末  |        |         |                | 業 種 等 |
|--|---------|--------|--------|---------|----------------|-------|
|  |         | 株数     | 評 価 額  |         | 業 種 等          |       |
|  |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |                |       |
| (ユーロ…アイルランド)                           | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |                |       |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC                | 32      | 25     | 73     | 8,473   | 容器・包装          |       |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC              | 115     | 115    | 18     | 2,193   | 銀行             |       |
| AIB GROUP PLC                          | 80      | 80     | 8      | 1,006   | 銀行             |       |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC              | 8       | 9      | 103    | 11,959  | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| 小 計                                    | 株数・金額   | 503    | 495    | 735     | 85,294         |       |
|  | 銘柄数<比率> | 8      | 8      | —       | <0.2%>         |       |
| (ユーロ…ポルトガル)                            |         |        |        |         |                |       |
| ENERGIAS DE PORTUGAL                   | 300     | 300    | 123    | 14,351  | 電力             |       |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS            | 58      | 58     | 59     | 6,902   | 石油・ガス・消耗燃料     |       |
| JERONIMO MARTINS                       | 25      | 28     | 43     | 5,018   | 食品・生活必需品小売り    |       |
| 小 計                                    | 株数・金額   | 383    | 386    | 226     | 26,272         |       |
|  | 銘柄数<比率> | 3      | 3      | —       | <0.1%>         |       |
| ユ ー ロ 計                                | 株数・金額   | 22,247 | 22,882 | 38,563  | 4,473,388      |       |
|  | 銘柄数<比率> | 239    | 237    | —       | <9.8%>         |       |
| (香港)                                   |         |        |        | 千香港ドル   |                |       |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY                 | 32      | 32     | 264    | 3,649   | 半導体・半導体製造装置    |       |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD               | 220     | 220    | 365    | 5,045   | 不動産管理・開発       |       |
| BANK OF EAST ASIA                      | 115     | 115    | 186    | 2,573   | 銀行             |       |
| CLP HLDGS                              | 205     | 205    | 1,640  | 22,632  | 電力             |       |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD     | 136     | 144    | 3,496  | 48,249  | 資本市場           |       |
| MTR CORP                               | 190     | 190    | 811    | 11,195  | 陸運・鉄道          |       |
| HANG LUNG GROUP LTD                    | 100     | —      | —      | —       | 不動産管理・開発       |       |
| HANG SENG BANK                         | 88      | 88     | 1,189  | 16,418  | 銀行             |       |
| HENDERSON LAND                         | 162     | 178    | 544    | 7,510   | 不動産管理・開発       |       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD              | 145     | 150    | 756    | 10,432  | 電力             |       |
| WHARF (HOLDING)                        | 102     | —      | —      | —       | 不動産管理・開発       |       |
| HONG KONG & CHINA GAS                  | 965     | 1,061  | 1,462  | 20,186  | ガス             |       |
| HYSAN DEVELOPMENT                      | 70      | —      | —      | —       | 不動産管理・開発       |       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L           | 300     | 240    | 1,288  | 17,785  | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| KERRY PROPERTIES                       | 65      | 65     | 141    | 1,955   | 不動産管理・開発       |       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD             | 370     | 380    | 913    | 12,611  | 銀行             |       |
| NWS HOLDINGS LTD                       | 190     | 190    | 147    | 2,034   | コンテンツ          |       |
| PCCW LTD                               | 410     | 410    | 195    | 2,693   | 各種電気通信サービス     |       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG               | 55      | 55     | 71     | 989     | 繊維・アパレル・贅沢品    |       |
| NEW WORLD DEVELOPMENT                  | 733     | 733    | 668    | 9,219   | 不動産管理・開発       |       |
| SHANGRI-LA ASIA LTD                    | 70      | —      | —      | —       | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| SINO LAND CO. LTD                      | 310     | 310    | 337    | 4,663   | 不動産管理・開発       |       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES                | 180     | 190    | 1,945  | 26,849  | 不動産管理・開発       |       |
| SWIRE PACIFIC-A                        | 50      | 50     | 249    | 3,439   | 不動産管理・開発       |       |
| VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED | —       | 80     | 225    | 3,113   | 食品             |       |
| WHEELOCK & COMPANY LTD                 | 80      | 80     | 462    | 6,375   | 不動産管理・開発       |       |
| TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED  | 180     | 180    | 1,168  | 16,121  | 機械             |       |
| MINTH GROUP LTD                        | 100     | —      | —      | —       | 自動車部品          |       |
| SJM HOLDINGS LIMITED                   | 240     | 240    | 194    | 2,682   | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| WYNN MACAU LTD                         | 180     | 180    | 254    | 3,512   | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD                 | 136     | —      | —      | —       | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| AIA GROUP LTD                          | 1,368   | 1,420  | 9,890  | 136,486 | 保険             |       |
| HKT TRUST AND HKT LTD                  | 381     | 381    | 482    | 6,659   | 各種電気通信サービス     |       |

| 銘柄                                   | 株数           | 株数     | 期 末       |        | 業 種 等                   |  |
|--------------------------------------|--------------|--------|-----------|--------|-------------------------|--|
|                                      |              |        | 評 価 額     |        |                         |  |
|                                      |              |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |                         |  |
| (香港)                                 | 百株           | 百株     | 千香港ドル     | 千円     |                         |  |
| SANDS CHINA LTD                      | 272          | 272    | 845       | 11,673 | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD                 | 108          | 108    | 232       | 3,211  | 不動産管理・開発                |  |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT         | 162          | 162    | 544       | 7,511  | 不動産管理・開発                |  |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT         | —            | 130    | 290       | 4,009  | 飲料                      |  |
| WH GROUP LIMITED                     | 1,060        | 1,060  | 755       | 10,429 | 食品                      |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD            | 289          | 339    | 1,926     | 26,584 | コングロマリット                |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD       | 90           | 90     | 408       | 5,638  | 電力                      |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD                | 294          | 294    | 1,432     | 19,769 | 不動産管理・開発                |  |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 10,204 | 10,024    | 35,791 | 493,917                 |  |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 39     | 35        | —      | < 1.1% >                |  |
| (シンガポール)                             |              |        | 千シンガポールドル |        |                         |  |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING           | 180          | 180    | 59        | 4,508  | 航空宇宙・防衛                 |  |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD            | 860          | —      | —         | —      | 食品                      |  |
| DBS GROUP HLDGS                      | 205          | 211    | 415       | 31,453 | 銀行                      |  |
| CITY DEVELOPMENTS LTD                | 40           | 40     | 32        | 2,421  | 不動産管理・開発                |  |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD           | 11           | 11     | 22        | 1,709  | 販売                      |  |
| SATS LTD                             | 80           | 80     | 23        | 1,797  | 運送インフラ                  |  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 70           | 90     | 88        | 6,680  | 資本市場                    |  |
| CAPITALAND LIMITED                   | 320          | 320    | 93        | 7,094  | 不動産管理・開発                |  |
| COMFORTDELGRO CORP LTD               | 320          | 210    | 33        | 2,526  | 陸運・鉄道                   |  |
| SINGAPORE AIRLINES LTD               | 80           | 80     | 35        | 2,669  | 旅客航空輸送業                 |  |
| SINGAPORE AIRLINE-MCB RIGHTS         | —            | 236    | —         | —      | 旅客航空輸送業                 |  |
| SINGAPORE AIRLINES LT-RIGHTS         | —            | 120    | 16        | 1,280  | 旅客航空輸送業                 |  |
| UNITED OVERSEAS BANK                 | 146          | 146    | 290       | 21,963 | 銀行                      |  |
| UOL GROUP LIMITED                    | 30           | 30     | 20        | 1,579  | 不動産管理・開発                |  |
| VENTURE CORP LTD                     | 32           | 32     | 50        | 3,811  | 電子装置・機器・部品              |  |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS             | 170          | 170    | 26        | 1,981  | メディア                    |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 920          | 920    | 250       | 18,935 | 各種電気通信サービス              |  |
| SEMBCORP INDUSTRIES                  | 120          | 120    | 19        | 1,452  | コングロマリット                |  |
| OCBC-ORD                             | 354          | 389    | 345       | 26,172 | 銀行                      |  |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD             | 170          | 180    | 62        | 4,726  | 食品                      |  |
| KEPPEL CORP.                         | 160          | 160    | 96        | 7,312  | コングロマリット                |  |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING             | 270          | 270    | 26        | 2,022  | 機械                      |  |
| GENTING SINGAPORE LTD                | 810          | 810    | 61        | 4,688  | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 5,348  | 4,805     | 2,072  | 156,790                 |  |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 21     | 22        | —      | < 0.3% >                |  |
| (オーストラリア)                            |              |        | 千豪ドル      |        |                         |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD               | 19           | 19     | 115       | 8,087  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK         | 327          | 321    | 504       | 35,284 | 銀行                      |  |
| AMCOR PLC-CDI                        | 140          | —      | —         | —      | 容器・包装                   |  |
| WESTPAC BANKING CORP                 | 393          | 422    | 654       | 45,737 | 銀行                      |  |
| BANK OF QUEENSLAND LTD               | 41           | —      | —         | —      | 銀行                      |  |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           | 150          | 150    | 180       | 12,620 | 金属・鉱業                   |  |
| TELSTRA CORP LTD                     | 420          | 420    | 127       | 8,892  | 各種電気通信サービス              |  |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD        | 37           | 37     | 21        | 1,522  | 銀行                      |  |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 | 43           | 43     | 37        | 2,602  | 飲料                      |  |
| ASX LTD                              | 20           | 20     | 164       | 11,502 | 資本市場                    |  |
| BHP GROUP LIMITED                    | 338          | 349    | 1,095     | 76,578 | 金属・鉱業                   |  |

| 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)                      | 百株      | 百株  | 千豪ドル  | 千円      |                         |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED       | 32      | 32  | 78    | 5,478   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD     | 58      | 58  | 17    | 1,241   | 複合小売り                   |
| COMPUTERSHARE LTD              | 66      | 66  | 75    | 5,271   | 情報技術サービス                |
| CSL LIMITED                    | 50      | 53  | 1,599 | 111,756 | バイオテクノロジー               |
| REA GROUP LTD                  | 6       | 6   | 57    | 3,990   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TRANSURBAN GROUP               | 305     | 305 | 415   | 29,044  | 運送インフラ                  |
| COCHLEAR LTD                   | 7       | 7   | 134   | 9,393   | ヘルスケア機器・用品              |
| ORIGIN ENERGY LTD              | 170     | 170 | 94    | 6,569   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 203     | 209 | 1,245 | 87,045  | 銀行                      |
| BORAL LTD                      | 140     | 140 | 38    | 2,690   | 建設資材                    |
| RIO TINTO LTD                  | 40      | 40  | 332   | 23,200  | 金属・鉱業                   |
| APA GROUP                      | 127     | 127 | 143   | 9,992   | ガス                      |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         | 57      | 77  | 192   | 13,441  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD  | 273     | 273 | 144   | 10,083  | 保険                      |
| TPG TELECOM LTD                | 43      | 43  | 31    | 2,211   | 各種電気通信サービス              |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 8       | 12  | 13    | 946     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ORICA LTD                      | 56      | 56  | 91    | 6,362   | 化学                      |
| BLUESCOPE STEEL LTD            | 73      | 73  | 73    | 5,136   | 金属・鉱業                   |
| WORLEY LTD                     | 26      | 26  | 22    | 1,555   | エネルギー設備・サービス            |
| SUNCORP GROUP LTD              | 137     | 133 | 118   | 8,282   | 保険                      |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK        | 303     | 384 | 617   | 43,148  | 銀行                      |
| NEWCREST MINING                | 78      | 101 | 278   | 19,479  | 金属・鉱業                   |
| OIL SEARCH LTD                 | 140     | 157 | 45    | 3,158   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INCITEC PIVOT LTD              | 170     | 170 | 37    | 2,601   | 化学                      |
| AMP LIMITED                    | 310     | 310 | 43    | 3,054   | 各種金融サービス                |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED         | —       | 100 | 34    | 2,375   | 旅客航空輸送業                 |
| QBE INSURANCE                  | 164     | 164 | 123   | 8,664   | 保険                      |
| CHALLENGER LIMITED             | 60      | 60  | 28    | 1,995   | 各種金融サービス                |
| SANTOS LTD.                    | 230     | 230 | 111   | 7,795   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SONIC HEALTHCARE LTD           | 49      | 49  | 126   | 8,868   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON   | 9       | 9   | 15    | 1,115   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TABCORP HOLDINGS               | 183     | 183 | 57    | 4,019   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESFARMERS LIMITED             | 130     | 130 | 486   | 34,021  | 複合小売り                   |
| ALUMINA LTD                    | 262     | 262 | 39    | 2,792   | 金属・鉱業                   |
| WOODSIDE PETROLEUM             | 115     | 122 | 267   | 18,662  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WOOLWORTHS GROUP LTD           | 142     | 149 | 517   | 36,130  | 食品・生活必需品小売り             |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD   | —       | 19  | 104   | 7,302   | 資本市場                    |
| SEEK LTD                       | 38      | 38  | 66    | 4,623   | 専門サービス                  |
| DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L   | 5       | —   | —     | —       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BRAMBLES LTD                   | 160     | 210 | 222   | 15,525  | 商業サービス・用品               |
| MACQUARIE GROUP LIMITED        | 39      | 35  | 368   | 25,727  | 資本市場                    |
| CROWN RESORTS LTD              | 48      | 48  | 44    | 3,132   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC    | 52      | 52  | 112   | 7,859   | 建設資材                    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD      | 91      | 91  | 89    | 6,257   | 飲料                      |
| SYDNEY AIRPORT                 | 90      | 160 | 87    | 6,093   | 運送インフラ                  |
| AURIZON HOLDINGS LTD           | 190     | 190 | 85    | 5,961   | 陸運・鉄道                   |
| AUSNET SERVICES                | 252     | 252 | 49    | 3,451   | 電力                      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD           | 300     | 300 | 84    | 5,932   | 保険                      |

| 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)  |  | 百株      | 百株      | 千豪ドル        | 千円         |                         |
|            | AGL ENERGY LTD                           | 63      | 63      | 103         | 7,259      | 総合公益事業                  |
|            | SOUTH32 LTD                              | 610     | 610     | 112         | 7,885      | 金属・鉱業                   |
|            | CIMIC GROUP LTD                          | 10      | 10      | 24          | 1,681      | 建設・土木                   |
|            | COLES GROUP LTD                          | 130     | 160     | 243         | 16,994     | 食品・生活必需品小売り             |
|            | WISETECH GLOBAL LTD                      | —       | 22      | 43          | 3,060      | ソフトウェア                  |
| 小 計        | 株 数 ・ 金 額                                | 8,232   | 8,532   | 12,495      | 873,158    |                         |
|            | 銘柄 数 < 比 率 >                             | 61      | 61      | —           | <1.9%>     |                         |
| (ニュージーランド) |  |         |         | 千ニュージーランドドル |            |                         |
|            | RYMAN HEALTHCARE LTD                     | 50      | 50      | 60          | 3,982      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
|            | A2 MILK CO LTD                           | 80      | 80      | 156         | 10,250     | 食品                      |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L | 65      | 65      | 193         | 12,708     | ヘルスケア機器・用品              |
|            | FLETCHER BUILDING LTD                    | 73      | 120     | 40          | 2,676      | 建設資材                    |
|            | SPARK NEW ZEALAND LTD                    | 200     | 200     | 92          | 6,036      | 各種電気通信サービス              |
|            | MERCURY NZ LTD                           | —       | 80      | 38          | 2,519      | 電力                      |
|            | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                | 130     | 120     | 68          | 4,471      | 運送インフラ                  |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD                      | 153     | 153     | 71          | 4,718      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| 小 計        | 株 数 ・ 金 額                                | 751     | 868     | 721         | 47,364     |                         |
|            | 銘柄 数 < 比 率 >                             | 7       | 8       | —           | <0.1%>     |                         |
| (イスラエル)    |  |         |         | 千新シェケル      |            |                         |
|            | BANK HAPOALIM BM                         | 140     | 140     | 322         | 9,805      | 銀行                      |
|            | BANK LEUMI LE-ISRAEL                     | 180     | 180     | 349         | 10,646     | 銀行                      |
|            | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP             | 250     | —       | —           | —          | 各種電気通信サービス              |
|            | ELBIT SYSTEMS LTD                        | 2       | 2       | 130         | 3,974      | 航空宇宙・防衛                 |
|            | ISRAEL DISCOUNT BANK-A                   | —       | 140     | 162         | 4,943      | 銀行                      |
|            | ISRAEL CHEMICALS LIMITED                 | 60      | 60      | 77          | 2,346      | 化学                      |
|            | NICE LTD                                 | 8       | 8       | 499         | 15,210     | ソフトウェア                  |
|            | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD                 | 11      | 11      | 78          | 2,386      | 銀行                      |
|            | AZRIELI GROUP                            | 4       | 4       | 79          | 2,423      | 不動産管理・開発                |
| 小 計        | 株 数 ・ 金 額                                | 655     | 545     | 1,699       | 51,736     |                         |
|            | 銘柄 数 < 比 率 >                             | 8       | 8       | —           | <0.1%>     |                         |
| 合 計        | 株 数 ・ 金 額                                | 139,433 | 127,717 | —           | 43,224,261 |                         |
|            | 銘柄 数 < 比 率 >                             | 1,252   | 1,254   | —           | <94.4%>    |                         |

\* 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により邦貨換算したものです。

\* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

| 銘柄                                   | 期首(前期末) |        | 当 期 末 |         |     |   |
|--------------------------------------|---------|--------|-------|---------|-----|---|
|                                      | 口 数     | 口 数    | 評 価 額 |         | 比 率 |   |
|                                      |         |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |     |   |
| (アメリカ)                               |         | 口      | 口     | 千米ドル    | 千円  | % |
| AGNC INVESTMENT CORP                 | 6,100   | 6,100  | 77    | 8,288   | 0.0 |   |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT         | 1,450   | 1,450  | 220   | 23,571  | 0.1 |   |
| AMERICAN TOWER CORP                  | 4,880   | 5,200  | 1,239 | 132,561 | 0.3 |   |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT            | 16,800  | 16,800 | 104   | 11,157  | 0.0 |   |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC            | 1,560   | 1,560  | 255   | 27,355  | 0.1 |   |
| BOSTON PROPERTIES                    | 1,660   | 1,660  | 144   | 15,429  | 0.0 |   |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | 2,669   | —      | —     | —       | —   |   |
| CAMDEN PROPERTY TRUST                | 960     | 960    | 84    | 9,082   | 0.0 |   |
| CROWN CASTLE INTL CORP               | 4,930   | 4,920  | 775   | 82,980  | 0.2 |   |
| DIGITAL REALTY TRUST INC             | 2,340   | 3,040  | 440   | 47,163  | 0.1 |   |
| DUKE REALTY CORP                     | 4,800   | 4,800  | 162   | 17,413  | 0.0 |   |
| EQUINIX INC                          | 870     | 980    | 664   | 71,078  | 0.2 |   |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES          | —       | 1,600  | 98    | 10,499  | 0.0 |   |
| EQUITY RESIDENTIAL                   | 4,500   | 4,500  | 288   | 30,907  | 0.1 |   |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC             | 680     | 690    | 170   | 18,201  | 0.0 |   |
| EXTRA SPACE STORAGE INC              | 1,610   | 1,610  | 147   | 15,788  | 0.0 |   |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST            | 780     | 780    | 60    | 6,516   | 0.0 |   |
| HCP INC                              | 6,100   | —      | —     | —       | —   |   |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC            | —       | 6,100  | 147   | 15,820  | 0.0 |   |
| HOST HOTELS & RESORTS INC            | 7,700   | 7,700  | 85    | 9,108   | 0.0 |   |
| INVITATION HOMES INC                 | 3,000   | 5,400  | 134   | 14,397  | 0.0 |   |
| IRON MOUNTAIN INC                    | 3,400   | 3,400  | 83    | 8,934   | 0.0 |   |
| KIMCO REALTY CORP                    | 5,000   | 5,000  | 54    | 5,828   | 0.0 |   |
| LIBERTY PROPERTY TRUST               | 1,400   | —      | —     | —       | —   |   |
| MACERICH CO /THE                     | 800     | —      | —     | —       | —   |   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC         | —       | 4,800  | 85    | 9,189   | 0.0 |   |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM           | 1,420   | 1,420  | 164   | 17,551  | 0.0 |   |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC       | 1,700   | 1,700  | 56    | 6,003   | 0.0 |   |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS           | —       | 2,000  | 55    | 5,899   | 0.0 |   |
| PROLOGIS INC                         | 6,900   | 8,700  | 782   | 83,713  | 0.2 |   |
| PUBLIC STORAGE                       | 1,700   | 1,900  | 361   | 38,678  | 0.1 |   |
| REALTY INCOME CORP                   | 3,300   | 4,100  | 224   | 24,055  | 0.1 |   |
| REGENCY CENTERS CORP                 | 1,400   | 2,300  | 96    | 10,321  | 0.0 |   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP              | 1,290   | 1,290  | 376   | 40,266  | 0.1 |   |
| SL GREEN REALTY CORP                 | 940     | 940    | 45    | 4,876   | 0.0 |   |
| SIMON PROPERTY GROUP INC             | 3,650   | 3,650  | 211   | 22,649  | 0.0 |   |
| SUN COMMUNITIES INC                  | —       | 1,210  | 162   | 17,362  | 0.0 |   |
| UDR INC                              | 3,400   | 3,400  | 130   | 13,941  | 0.0 |   |
| VENTAS INC                           | 4,200   | 4,200  | 126   | 13,520  | 0.0 |   |
| VEREIT INC                           | 11,100  | 11,100 | 60    | 6,505   | 0.0 |   |
| VICI PROPERTIES INC                  | —       | 4,400  | 75    | 8,042   | 0.0 |   |
| VORNADO REALTY TRUST                 | 1,770   | 1,770  | 69    | 7,460   | 0.0 |   |
| WP CAREY INC                         | 1,800   | 1,800  | 112   | 12,049  | 0.0 |   |
| WELLTOWER INC                        | 4,230   | 5,100  | 227   | 24,299  | 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     | 邦貨換算金額   |     |
| (アメリカ)                               |               | 口       | 口       | 千米ドル      | 千円       | %   |
| WEYERHAEUSER CO                      |               | 8,300   | 8,300   | 164       | 17,620   | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額     | 141,089 | 158,330 | 9,033     | 966,094  |     |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 39      | 41      | —         | < 2.1% > |     |
| (カナダ)                                |               |         |         | 千カナダドル    |          |     |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA         |               | —       | 400     | 19        | 1,508    | 0.0 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT |               | —       | 1,100   | 14        | 1,099    | 0.0 |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS         |               | 1,200   | 1,200   | 11        | 866      | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR          |               | 1,986   | 1,986   | 29        | 2,275    | 0.0 |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV         |               | 700     | 700     | 14        | 1,084    | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額     | 3,886   | 5,386   | 89        | 6,834    |     |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 5       | —         | < 0.0% > |     |
| (イギリス)                               |               |         |         | 千英ポンド     |          |     |
| BRITISH LAND                         |               | 9,100   | 9,100   | 35        | 4,702    | 0.0 |
| HAMMERSON PLC                        |               | 8,600   | —       | —         | —        | —   |
| SEGRO PLC                            |               | 9,360   | 14,700  | 120       | 16,060   | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC            |               | 7,312   | 7,312   | 47        | 6,253    | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額     | 34,372  | 31,112  | 203       | 27,017   |     |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 3       | —         | < 0.1% > |     |
| (ユーロ…フランス)                           |               |         |         | 千ユーロ      |          |     |
| ICADE                                |               | 230     | 230     | 15        | 1,784    | 0.0 |
| KLEPIERRE                            |               | 2,200   | 2,200   | 37        | 4,385    | 0.0 |
| GECINA SA                            |               | 560     | 560     | 62        | 7,301    | 0.0 |
| COVIVIO                              |               | 560     | 560     | 30        | 3,494    | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD            |               | 1,470   | 1,490   | 75        | 8,731    | 0.0 |
| ユ ー ロ 計                              | 口 数 ・ 金 額     | 5,020   | 5,040   | 221       | 25,698   |     |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5       | —         | < 0.1% > |     |
| (香港)                                 |               |         |         | 千香港ドル     |          |     |
| LINK REIT                            |               | 23,500  | 26,000  | 1,779     | 24,559   | 0.1 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS          |               | 30,000  | 30,000  | 240       | 3,316    | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額     | 53,500  | 56,000  | 2,020     | 27,876   |     |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 2       | —         | < 0.1% > |     |
| (シンガポール)                             |               |         |         | 千シンガポールドル |          |     |
| CAPITALAND MALL TRUST                |               | 27,800  | 27,800  | 51        | 3,891    | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT         |               | 34,000  | 40,040  | 117       | 8,877    | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST          |               | 22,154  | 37,954  | 60        | 4,566    | 0.0 |
| SUNTEC REIT                          |               | 29,000  | 29,000  | 39        | 2,962    | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST           |               | —       | 24,000  | 45        | 3,450    | 0.0 |
| 小 計                                  | 口 数 ・ 金 額     | 112,954 | 158,794 | 313       | 23,748   |     |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 5       | —         | < 0.1% > |     |
| (オーストラリア)                            |               |         |         | 千豪ドル      |          |     |
| MIRVAC GROUP                         |               | 36,000  | 36,000  | 78        | 5,509    | 0.0 |
| GPT GROUP                            |               | 26,000  | 26,000  | 104       | 7,285    | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP                      |               | 6,600   | 6,600   | 74        | 5,174    | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP                |               | 25,800  | 25,800  | 70        | 4,939    | 0.0 |
| DEXUS                                |               | 13,200  | 13,200  | 116       | 8,163    | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                        |               | 16,700  | 17,600  | 252       | 17,661   | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                        |               | 68,000  | 52,000  | 114       | 7,994    | 0.0 |

| 銘 柄                           | 期首(前期末)              |             | 当 期 末      |             |          |
|-------------------------------|----------------------|-------------|------------|-------------|----------|
|                               | 口 数                  | 口 数         | 評 価 額      |             | 比 率      |
|                               |                      |             | 外貨建金額      | 邦貨換算金額      |          |
| (オーストラリア)<br>VICINITY CENTRES | 口<br>44,000          | 口<br>44,000 | 千豪ドル<br>62 | 千円<br>4,396 | %<br>0.0 |
| 小 計                           | 口 数 ・ 金 額<br>236,300 | 221,200     | 874        | 61,125      |          |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                 | 8                    | 8           | —          | <0.1%>      |          |
| 合 計                           | 口 数 ・ 金 額<br>587,121 | 635,862     | —          | 1,138,394   |          |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                 | 65                   | 69          | —          | <2.5%>      |          |

\*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により邦貨換算したものです。

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 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 国   | 株式先物取引 | CAN60    | 百万円<br>55 | 百万円<br>— |
|       |        | EURO50   | 187       | —        |
|       |        | FT100    | 70        | —        |
|       |        | SPI200   | 28        | —        |
|       |        | SPEMINI  | 1,331     | —        |
|       |        | SWISSMKT | 63        | —        |

\*単位未満は切り捨て。

\*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により邦貨換算したものです。

### ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>43,224,261 | %<br>92.3 |
| 投資証券         | 1,138,394        | 2.4       |
| コール・ローン等、その他 | 2,460,733        | 5.3       |
| 投資信託財産総額     | 46,823,388       | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産（45,383,494千円）の投資信託財産総額（46,823,388千円）に対する比率は96.9%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=106.95円、1カナダドル=76.74円、1英ポンド=132.85円、1スイスフラン=110.20円、1スウェーデンクローナ=10.92円、1ノルウェークローネ=10.44円、1デンマーククローネ=15.55円、1ユーロ=116.00円、1香港ドル=13.80円、1シンガポールドル=75.67円、1豪ドル=69.88円、1ニュージーランドドル=65.61円、1新シッケル=30.44円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月11日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 92,688,589,450  |
| コール・ローン等        | 1,213,611,633   |
| 株式(評価額)         | 43,224,261,251  |
| 投資証券(評価額)       | 1,138,394,940   |
| 未収入金            | 46,365,150,166  |
| 未収配当金           | 51,862,007      |
| 差入委託証拠金         | 695,309,453     |
| (B) 負債          | 46,921,729,135  |
| 未払金             | 45,958,783,999  |
| 未払解約金           | 961,683,968     |
| 未払利息            | 768             |
| その他未払費用         | 1,260,400       |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 45,766,860,315  |
| 元本              | 24,385,300,928  |
| 次期繰越損益金         | 21,381,559,387  |
| (D) 受益権総口数      | 24,385,300,928口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,768円         |

(注) 期首元本額は24,834,621,703円、期中追加設定元本額は8,600,499,035円、期中一部解約元本額は9,049,819,810円、1口当たり純資産額は1.8768円です。

## ○損益の状況 (2019年5月11日～2020年5月11日)

| 項目                 | 当期               |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | 984,658,884      |
| 受取配当金              | 978,303,571      |
| 受取利息               | 658,502          |
| その他収益金             | 6,234,699        |
| 支払利息               | △ 537,888        |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 1,751,403,659  |
| 売買益                | 9,451,016,128    |
| 売買損                | △ 11,202,419,787 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 195,393,378    |
| 取引益                | 616,535,009      |
| 取引損                | △ 811,928,387    |
| (D) 保管費用等          | △ 8,633,596      |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 970,771,749    |
| (F) 前期繰越損益金        | 22,366,702,533   |
| (G) 追加信託差損益金       | 7,909,702,988    |
| (H) 解約差損益金         | △ 7,924,074,385  |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 21,381,559,387   |
| 次期繰越損益金(I)         | 21,381,559,387   |

\*損益の状況の中で(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えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、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をいいます。

\*損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名  | 当期末<br>元本額    |
|--|---------------|
|  | 円             |
| 野村インデックス・バランス60VA (適格機関投資家専用)                    | 7,830,850,490 |
| 野村外国株インデックス Aコース (野村投資一任口座向け)                    | 7,403,700,475 |
| 野村外国株 (含む新興国) インデックス Aコース (野村投資一任口座向け)           | 2,352,557,167 |
| 野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型                         | 2,063,111,293 |
| 野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA (適格機関投資家専用)             | 1,540,320,107 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型                    | 1,179,595,133 |
| 野村外国株インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)                    | 657,860,845   |
| ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA (適格機関投資家専用)            | 476,808,594   |
| NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数 (為替ヘッジあり) 運動型上場投信 | 320,971,733   |
| ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 外国株式                         | 300,768,635   |
| 野村国内外マルチアセット (6資産) オープン投信 (適格機関投資家専用)            | 181,517,555   |
| 野村国内外マルチアセット (6資産) ファンド (適格機関投資家専用)              | 49,224,943    |
| インデックス・ブレンド (タイプⅢ)                               | 10,698,143    |
| インデックス・ブレンド (タイプⅤ)                               | 6,543,595     |
| インデックス・ブレンド (タイプⅠ)                               | 4,147,595     |
| インデックス・ブレンド (タイプⅡ)                               | 3,439,039     |
| インデックス・ブレンド (タイプⅣ)                               | 2,590,551     |
| 野村MSCI-KOKUSAIインデックスオープン投信・為替ヘッジ型 (適格機関投資家専用)    | 595,035       |

○お知らせ

---

該当事項はございません。

# 新興国株式マザーファンド

## 運用報告書

第12期（決算日2020年5月11日）

作成対象期間（2019年5月11日～2020年5月11日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |
|--------|--|
| 運用方針   | MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。   |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。   |

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |       | ベンチマーク |       | 株式組入比率 | 株先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額  |
|-----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|------------|--------|
|                 | 円      | 騰落率   | 円      | 騰落率   |        |       |            |        |
| 8期(2016年5月10日)  | 8,770  | △28.3 | 88.42  | △27.9 | 95.5   | 3.9   | 0.6        | 12,986 |
| 9期(2017年5月10日)  | 11,642 | 32.7  | 117.96 | 33.4  | 95.7   | 3.7   | 0.5        | 21,796 |
| 10期(2018年5月10日) | 13,270 | 14.0  | 134.93 | 14.4  | 97.5   | 2.1   | 0.4        | 33,831 |
| 11期(2019年5月10日) | 12,185 | △8.2  | 124.66 | △7.6  | 95.5   | 3.3   | 1.1        | 36,658 |
| 12期(2020年5月11日) | 10,763 | △11.7 | 110.86 | △11.1 | 90.8   | 4.9   | 4.3        | 36,969 |

\*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*ベンチマーク (=「MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)」) は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・ドルベース) をもとに当社が円換算したものです。なお指数算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。

\*MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目録見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI、為替レート (対顧客電信売買相場仲値)

## ○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 |       | 株式組入比率 | 株先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|------------|
|            | 円      | 騰落率   | 円      | 騰落率   |        |       |            |
| (期首)       | 円      | %     |        | %     | %      | %     | %          |
| 2019年5月10日 | 12,185 | —     | 124.66 | —     | 95.5   | 3.3   | 1.1        |
| 5月末        | 11,747 | △3.6  | 120.32 | △3.5  | 94.6   | 3.5   | 1.8        |
| 6月末        | 12,365 | 1.5   | 126.51 | 1.5   | 94.2   | 3.8   | 1.9        |
| 7月末        | 12,369 | 1.5   | 126.79 | 1.7   | 94.7   | 3.3   | 1.9        |
| 8月末        | 11,320 | △7.1  | 115.84 | △7.1  | 94.0   | 3.1   | 2.8        |
| 9月末        | 11,821 | △3.0  | 121.53 | △2.5  | 94.7   | 2.5   | 2.7        |
| 10月末       | 12,462 | 2.3   | 127.67 | 2.4   | 94.6   | 2.7   | 2.7        |
| 11月末       | 12,640 | 3.7   | 129.64 | 4.0   | 93.2   | 2.6   | 4.1        |
| 12月末       | 13,463 | 10.5  | 138.52 | 11.1  | 93.6   | 2.3   | 4.0        |
| 2020年1月末   | 12,822 | 5.2   | 132.28 | 6.1   | 93.4   | 2.5   | 4.0        |
| 2月末        | 12,384 | 1.6   | 127.62 | 2.4   | 91.7   | 3.7   | 4.5        |
| 3月末        | 9,986  | △18.0 | 102.74 | △17.6 | 90.9   | 4.5   | 4.4        |
| 4月末        | 10,873 | △10.8 | 111.70 | △10.4 | 91.1   | 4.6   | 4.2        |
| (期末)       |        |       |        |       |        |       |            |
| 2020年5月11日 | 10,763 | △11.7 | 110.86 | △11.1 | 90.8   | 4.9   | 4.3        |

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり、新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

新興国株式市場は、期首より、米中貿易交渉の状況などを受け一進一退の展開となりました。2019年9月以降は米中貿易協議進展への期待などを受け上昇しました。2020年1月中旬以降は、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり、新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に下落しました。

為替市場は、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の減速懸念などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、各国通貨が概ね対円で下落（円高）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、新興国の株式（ETF（上場投資信託証券）やDR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行いました。期中の資金流入や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、実質株式比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-11.7%となり、ベンチマークの-11.1%を0.6ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

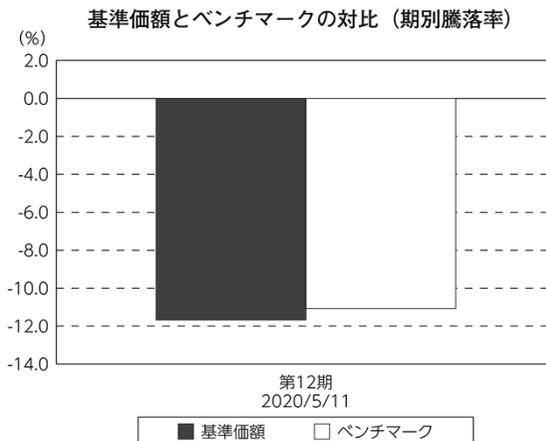
### （その他の要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）

## ◎今後の運用方針

引き続き、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



（注）ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月11日～2020年5月11日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要  |   |
|-----------------------|--------|------------|--|---|
|                       | 金 額    | 比 率        |  |   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>5 | %<br>0.041 | (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)                 | (4)    | (0.034)    |  |   |
| (新株予約権証券)             | (0)    | (0.000)    |  |   |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.002)    |  |   |
| (先物・オプション)            | (1)    | (0.005)    |  |   |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2      | 0.019      | (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)                 | (2)    | (0.019)    |  |   |
| (新株予約権証券)             | (0)    | (0.000)    |  |   |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |  |   |
| (c) そ の 他 費 用         | 11     | 0.088      | (c) 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)             | (9)    | (0.079)    |  | 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 |
| (そ の 他)               | (1)    | (0.010)    |  | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                |
| 合 計                   | 18     | 0.148      |  |   |
| 期中の平均基準価額は、12,021円です。 |        |            |  |   |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 株式

|        |        | 買 付                     |                                 | 売 付                |                                |
|--------|--------|-------------------------|---------------------------------|--------------------|--------------------------------|
|        |        | 株 数                     | 金 額                             | 株 数                | 金 額                            |
| 外<br>国 | カタール   | 百株<br>1,369<br>(12,674) | 千カタールリヤル<br>2,984<br>( )        | 百株<br>687          | 千カタールリヤル<br>1,010              |
|        | アメリカ   | 14,613<br>( 269)        | 千米ドル<br>11,251<br>( 101)        | 7,048              | 千米ドル<br>3,738                  |
|        | イギリス   | 97                      | 千英ポンド<br>100                    | 47                 | 千英ポンド<br>55                    |
|        | トルコ    | 1,364<br>( 126)         | 千トルコリラ<br>1,538<br>( )          | 1,815              | 千トルコリラ<br>1,293                |
|        | ユーロ    |                         | 千ユーロ                            |                    | 千ユーロ                           |
|        | ギリシャ   | 2,645                   | 270                             | 320                | 62                             |
|        | チェコ    | 187                     | 千チェココルナ<br>2,770                | 19                 | 千チェココルナ<br>920                 |
|        | ハンガリー  | 35                      | 千フォリント<br>31,779                | 10                 | 千フォリント<br>14,014               |
|        | ポーランド  | 192                     | 千ズロチ<br>1,592                   | 215                | 千ズロチ<br>1,327                  |
|        | 香港     | 74,820<br>( 694)        | 千香港ドル<br>90,879<br>(△ 235)      | 72,668<br>( 1,382) | 千香港ドル<br>47,324<br>( 271)      |
|        | マレーシア  | 5,090                   | 千リンギ<br>3,707                   | 7,310              | 千リンギ<br>2,668                  |
|        | タイ     | 30,963<br>(10,724)      | 千バーツ<br>100,419<br>( 2,875)     | 3,808<br>( 4,756)  | 千バーツ<br>24,447<br>( 1,616)     |
|        | フィリピン  | 7,323<br>( 150)         | 千フィリピンペソ<br>27,660<br>( )       | 6,770              | 千フィリピンペソ<br>21,429             |
|        | インドネシア | 22,254<br>(21,388)      | 千ルピア<br>12,653,538<br>( )       | 19,082             | 千ルピア<br>8,059,754              |
|        | 韓国     | 1,309<br>( 55)          | 千ウォン<br>5,659,175<br>( 67,796)  | 765<br>( 9)        | 千ウォン<br>4,512,375<br>( 21,135) |
|        | 台湾     | 23,390<br>( 3,503)      | 千新台幣ドル<br>140,555<br>( 3,194)   | 19,610<br>( 1,037) | 千新台幣ドル<br>113,309<br>( 404)    |
|        | インド    | 7,513<br>( 1,207)       | 千インドルピー<br>482,866<br>( 10,991) | 7,545<br>( 270)    | 千インドルピー<br>200,645<br>( 2,841) |
|        | パキスタン  | 121                     | 千パキスタトルピー<br>1,654              | —                  | 千パキスタトルピー<br>—                 |
|        | メキシコ   | 7,074<br>( )            | 千メキシコペソ<br>17,645<br>(△ 184)    | 8,023              | 千メキシコペソ<br>18,672              |

|        |          | 買 付                     |                               | 売 付         |                      |
|--------|----------|-------------------------|-------------------------------|-------------|----------------------|
|        |          | 株 数                     | 金 額                           | 株 数         | 金 額                  |
| 外<br>国 | ブラジル     | 百株<br>6,011<br>( 1,593) | 千レアル<br>19,131<br>(△ 59)      | 百株<br>2,637 | 千レアル<br>8,129        |
|        | チリ       | 1,155<br>( 1)           | 千チリペソ<br>85,951<br>( ー)       | 1,083       | 千チリペソ<br>83,515      |
|        | コロンビア    | 132                     | 千コロンビアペソ<br>234,784           | 474         | 千コロンビアペソ<br>583,090  |
|        | アラブ首長国連邦 | 1,930                   | 千UAEディルハム<br>541              | 1,444       | 千UAEディルハム<br>247     |
|        | エジプト     | 133                     | 千エジプトポンド<br>962               | ー           | 千エジプトポンド<br>ー        |
|        | 南アフリカ    | 4,491<br>( 181)         | 千ランド<br>39,989<br>( ー)        | 2,768       | 千ランド<br>51,894       |
|        | サウジアラビア  | 10,454<br>( 160)        | 千サウジアラビアリヤル<br>41,061<br>( ー) | 403         | 千サウジアラビアリヤル<br>1,186 |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### 新株予約権証券

|        |    | 買 付                  |                   | 売 付                      |                    |
|--------|----|----------------------|-------------------|--------------------------|--------------------|
|        |    | 証 券 数                | 金 額               | 証 券 数                    | 金 額                |
| 外<br>国 | タイ | 証券<br>ー<br>(103,350) | 千バーツ<br>ー<br>( ー) | 証券<br>55,750<br>(55,750) | 千バーツ<br>66<br>( ー) |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 投資信託証券

| 銘柄                         |  | 買付           |                 | 売付             |            |
|----------------------------|--|--------------|-----------------|----------------|------------|
|                            |  | 口数           | 金額              | 口数             | 金額         |
| 外国                         | アメリカ                                     |              | 千米ドル            |                | 千米ドル       |
|                            | XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF | 457,900      | 12,589          | 41,600         | 1,112      |
|                            | 小計                                       | 457,900      | 12,589          | 41,600         | 1,112      |
|                            | メキシコ                                     |              | 千メキシコペソ         |                | 千メキシコペソ    |
|                            | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA              | —<br>( —)    | —<br>(△ 228)    | —              | —          |
|                            | 小計                                       | —<br>( —)    | —<br>(△ 228)    | —              | —          |
|                            | 南アフリカ                                    |              | 千ランド            |                | 千ランド       |
|                            | FORTRESS REIT LTD-A                      | 40,350       | 844             | —<br>( —)      | —<br>( 80) |
|                            | FORTRESS REIT LTD-B                      | —            | —               | 43,946         | 432        |
|                            | REDEFINE PROPERTIES LTD                  | —            | —               | 59,000         | 573        |
| HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS | —  | —            | 13,650          | 930            |            |
| RESILIENT REIT LTD         | —<br>( 1,281)                            | —<br>( 80)   | 16,373          | 901            |            |
| 小計                         | 40,350<br>( 1,281)                       | 844<br>( 80) | 132,969<br>( —) | 2,837<br>( 80) |            |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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>12,361 | 百万円<br>11,602 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*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

(2019年5月11日～2020年5月11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       | 10,523,951千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 36,582,504千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.28         |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A          |               |           | 売付額等<br>C          |               |           |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
|        | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ |           | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |           |
| 為替直物取引 | 百万円<br>12,922      | 百万円<br>3,599  | %<br>27.9 | 百万円<br>8,075       | 百万円<br>3,577  | %<br>44.3 |

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2020年5月11日現在)

## 外国株式

| 銘柄   | 株数      | 株数    | 期末      |           | 業種等                  |  |
|--|---------|-------|---------|-----------|----------------------|--|
|  |         |       | 評価額     |           |                      |  |
|  |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                      |  |
| (カタル)  | 百株      | 百株    | 千カタルリヤル | 千円        |                      |  |
| QATAR INSURANCE CO                           | 100     | 1,000 | 197     | 5,762     | 保険                   |  |
| QATAR NATIONAL BANK                          | 283     | 2,892 | 4,965   | 145,242   | 銀行                   |  |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR                     | 117     | 1,179 | 468     | 13,690    | 銀行                   |  |
| OOREDOO QSC                                  | 43      | 431   | 263     | 7,705     | 各種電気通信サービス           |  |
| QATAR FUEL CO                                | —       | 347   | 558     | 16,330    | 石油・ガス・消耗燃料           |  |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO                 | 34      | 344   | 520     | 15,223    | 総合公益事業               |  |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC INDUSTRIES QATAR | —       | 470   | 381     | 11,150    | 銀行                   |  |
| QATAR ISLAMIC BANK                           | 111     | 1,117 | 854     | 24,994    | コングロマリット             |  |
| MASRAF AL RAYAN                              | 65      | 804   | 1,217   | 35,604    | 銀行                   |  |
| BARWA REAL ESTATE CO                         | 211     | 2,116 | 801     | 23,445    | 銀行                   |  |
| EZDAN HOLDING GROUP                          | 113     | 1,130 | 320     | 9,386     | 不動産管理・開発             |  |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING               | 441     | —     | —       | —         | 不動産管理・開発             |  |
|  | —       | 3,050 | 623     | 18,235    | 化学                   |  |
| 小計   | 株数・金額   | 1,522 | 14,880  | 11,171    | 326,773              |  |
|  | 銘柄数<比率> | 10    | 12      | —         | <0.9%>               |  |
| (アメリカ)                                       |         |       | 千米ドル    |           |                      |  |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR                 | 810     | 1,117 | 22,472  | 2,403,479 | インターネット販売・通信販売       |  |
| AUTOHOME INC-ADR                             | 38      | 38    | 311     | 33,302    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| BAIDU INC - SPON ADR                         | 174     | 178   | 1,784   | 190,893   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| BANCO DE CHILE-ADR                           | 83      | 143   | 249     | 26,672    | 銀行                   |  |
| BANCO MACRO SA-ADR                           | —       | 38    | 70      | 7,522     | 銀行                   |  |
| BANCO SANTANDER CHILE-ADR                    | 95      | 124   | 207     | 22,173    | 銀行                   |  |
| BANCOLOMBIA S. A.-SPONS ADR                  | 73      | 73    | 183     | 19,598    | 銀行                   |  |
| BAOZUN INC-SPN ADR                           | 23      | 23    | 68      | 7,313     | インターネット販売・通信販売       |  |
| BEST INC - ADR                               | —       | 86    | 45      | 4,837     | 航空貨物・物流サービス          |  |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR                   | 40      | 40    | 55      | 5,929     | 飲料                   |  |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR                 | 111     | 170   | 143     | 15,327    | 金属・鉱業                |  |
| CTRIIP.COM INTERNATIONAL -ADR                | 258     | —     | —       | —         | インターネット販売・通信販売       |  |
| ECOPETROL SA-SPONSORED ADR                   | 146     | 183   | 195     | 20,961    | 石油・ガス・消耗燃料           |  |
| ENEL AMERICAS S. A-ADR                       | 373     | 484   | 395     | 42,342    | 電力                   |  |
| ENEL CHILE SA-ADR                            | 309     | 429   | 157     | 16,838    | 電力                   |  |
| 58.COM INC-ADR                               | 57      | 57    | 302     | 32,336    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| 51JOB INC-ADR                                | 13      | 13    | 84      | 9,015     | 専門サービス               |  |
| GDS HOLDINGS LTD-ADR                         | 32      | 43    | 273     | 29,205    | 情報技術サービス             |  |
| GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR                 | —       | 74    | 60      | 6,436     | 銀行                   |  |
| HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR                    | 88      | 88    | 292     | 31,255    | ホテル・レストラン・レジャー       |  |
| HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD - ADR           | 38      | 38    | 84      | 9,069     | 医薬品                  |  |
| HUYA INC-ADR                                 | —       | 27    | 42      | 4,576     | 娯楽                   |  |
| ITAU CORPBANCA-ADR                           | 54      | 54    | 22      | 2,431     | 銀行                   |  |
| IQIYI INC-ADR                                | 91      | 91    | 159     | 17,060    | 娯楽                   |  |
| JOYY INC                                     | —       | 42    | 233     | 24,999    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| JD.COM INC-ADR                               | 466     | 480   | 2,246   | 240,299   | インターネット販売・通信販売       |  |
| STATE BANK OF INDIA-GDR                      | 110     | 110   | 249     | 26,697    | 銀行                   |  |
| PJSC GAZPROM-ADR                             | 3,317   | 3,428 | 1,709   | 182,799   | 石油・ガス・消耗燃料           |  |
| LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR                  | 203     | 151   | 47      | 5,119     | 旅客航空輸送業              |  |
| TRANSNEFT PJSC                               | 0.21    | 0.21  | 38      | 4,138     | 石油・ガス・消耗燃料           |  |

| 銘柄                             | 株数     | 金額       | 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      |        |           |                      |
| LUCKIN COFFEE INC - ADR        | —      | 52       | 22      | 2,441   |        |           | ホテル・レストラン・レジャー       |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B    | 577    | 577      | 35      | 3,776   |        |           | 石油・ガス・消耗燃料           |
| MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR    | 286    | 286      | 250     | 26,841  |        |           | 無線通信サービス             |
| MOMO INC-SPON ADR              | 88     | 88       | 197     | 21,166  |        |           | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| NTO INC ADR                    | —      | 409      | 154     | 16,490  |        |           | 自動車                  |
| NETEASE INC-ADR                | 49     | 45       | 1,633   | 174,687 |        |           | 娯楽                   |
| NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR  | 91     | 94       | 1,199   | 128,330 |        |           | 各種消費者サービス            |
| NOAH HLDS LTD ADR              | 15     | 15       | 40      | 4,318   |        |           | 資本市場                 |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B   | 730    | 876      | 74      | 7,920   |        |           | 不動産管理・開発             |
| PINDUODUO INC ADR              | 132    | 130      | 709     | 75,913  |        |           | インターネット販売・通信販売       |
| QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR   | 74     | 74       | 171     | 18,321  |        |           | 化学                   |
| SOUTHERN COPPER CORP           | 47     | 63       | 217     | 23,211  |        |           | 金属・鉱業                |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR        | 227    | 246      | 1,350   | 144,411 |        |           | 各種消費者サービス            |
| TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR    | —      | 53       | 37      | 4,030   |        |           | 各種電気通信サービス           |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR   | 74     | 74       | 81      | 8,729   |        |           | 娯楽                   |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR         | —      | 294      | 738     | 78,985  |        |           | インターネット販売・通信販売       |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS     | 266    | 266      | 456     | 48,874  |        |           | インターネット販売・通信販売       |
| WEIBO CORP-SPON ADR            | 34     | 34       | 124     | 13,268  |        |           | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| YPF S. A. -SPONSORED ADR       | —      | 106      | 42      | 4,591   |        |           | 石油・ガス・消耗燃料           |
| YY INC-ADR                     | 30     | —        | —       | —       |        |           | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| YUM CHINA HOLDINGS INC         | 224    | 231      | 1,124   | 120,256 |        |           | ホテル・レストラン・レジャー       |
| ZAI LAB LTD - ADR              | —      | 23       | 153     | 16,371  |        |           | バイオテクノロジー            |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC         | 216    | 209      | 651     | 69,628  |        |           | 航空貨物・物流サービス          |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR          | 1,229  | 1,037    | 508     | 54,344  |        |           | 石油・ガス・消耗燃料           |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR   | 85     | 85       | 257     | 27,544  |        |           | 食品・生活必需品小売り          |
| NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S   | 55     | 57       | 805     | 86,136  |        |           | 石油・ガス・消耗燃料           |
| NOVOLIPET STEEL - GDR REG S    | 73     | 73       | 124     | 13,344  |        |           | 金属・鉱業                |
| ROSNEFT OJSC - GDR             | 728    | 728      | 336     | 35,947  |        |           | 石油・ガス・消耗燃料           |
| PJSC ALROSA                    | 1,760  | 1,760    | 149     | 15,997  |        |           | 金属・鉱業                |
| SEVERSTAL-GDR REG S            | 113    | 158      | 185     | 19,855  |        |           | 金属・鉱業                |
| MAGNITOGORS-SPON GDR REGS      | 107    | 107      | 71      | 7,690   |        |           | 金属・鉱業                |
| VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI     | 878    | 878      | 82      | 8,849   |        |           | 銀行                   |
| DP WORLD PLC                   | 110    | 110      | 175     | 18,811  |        |           | 運送インフラ               |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS      | 205    | 197      | 222     | 23,766  |        |           | 食品・生活必需品小売り          |
| INTER RAO UES PJSC             | 16,690 | 22,800   | 151     | 16,201  |        |           | 電力                   |
| PJSC SBERBANK OF RUSSIA        | 6,734  | 6,733    | 1,797   | 192,247 |        |           | 銀行                   |
| PJSC PHOSAGRO-GDR REG S        | 70     | 70       | 86      | 9,221   |        |           | 化学                   |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC | 851    | 851      | 147     | 15,767  |        |           | 資本市場                 |
| PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR    | 401    | 395      | 1,081   | 115,625 |        |           | 金属・鉱業                |
| POLYUS PJSC-REG S-GDR          | 39     | 33       | 267     | 28,633  |        |           | 金属・鉱業                |
| TATNEFT-SPONSORED ADR          | 162    | 162      | 719     | 76,933  |        |           | 石油・ガス・消耗燃料           |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR           | 307    | 271      | 1,781   | 190,537 |        |           | 石油・ガス・消耗燃料           |
| CREDICORP LTD                  | 43     | 43       | 633     | 67,765  |        |           | 銀行                   |
| SINA CORP                      | 41     | 41       | 140     | 14,984  |        |           | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| GLOBALANT SA                   | —      | 25       | 313     | 33,487  |        |           | ソフトウェア               |
| 小 計                            | 株 数    | 金 額      | 40,861  | 48,695  | 51,696 | 5,528,897 |                      |
|                                | 銘柄     | 数 < 比率 > | 63      | 73      | —      | < 15.0% > |                      |
| (イギリス)                         |        |          |         |         | 千英ポンド  |           |                      |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC    | 100    | 150      | 246     | 32,760  |        |           | 金属・鉱業                |
| 小 計                            | 株 数    | 金 額      | 100     | 150     | 246    | 32,760    |                      |
|                                | 銘柄     | 数 < 比率 > | 1       | 1       | —      | < 0.1% >  |                      |

| 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  |                |  |
| (トルコ)                                   | 百株           | 百株    | 千トルコリラ  | 千円      |                |  |
| AKBANK T. A. S                          | 1,980        | 2,050 | 1,139   | 17,199  | 銀行             |  |
| ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII  | 127          | 127   | 217     | 3,275   | 飲料             |  |
| ARCELIK A. S                            | 145          | 145   | 223     | 3,379   | 家庭用耐久財         |  |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI               | 207          | 207   | 549     | 8,289   | 航空宇宙・防衛        |  |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK            | 782          | 1,110 | 893     | 13,483  | 金属・鉱業          |  |
| FORD OTOMOTIVE SANAYI AS                | 33           | 33    | 182     | 2,747   | 自動車            |  |
| KOC HLDGS                               | 530          | 530   | 793     | 11,972  | コングロマリット       |  |
| PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS            | 413          | —     | —       | —       | 化学             |  |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS         | 423          | —     | —       | —       | コングロマリット       |  |
| TURK HAVA YOLLARI AO                    | 321          | 321   | 341     | 5,148   | 旅客航空輸送業        |  |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS             | 770          | 770   | 1,031   | 15,569  | 無線通信サービス       |  |
| TURKIYE GARANTI BANKASI                 | 1,421        | 1,421 | 1,117   | 16,861  | 銀行             |  |
| TURKIYE IS BANKASI AS-C                 | 918          | 918   | 447     | 6,746   | 銀行             |  |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE            | 83           | 83    | 705     | 10,639  | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| HACI OMER SABANCI HOLDING               | 478          | 750   | 600     | 9,065   | 各種金融サービス       |  |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS               | 126          | 300   | 1,530   | 23,087  | 食品・生活必需品小売り    |  |
| TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS            | 96           | 96    | 167     | 2,521   | 運送インフラ         |  |
| TURKIYE HALK BANKASI                    | 328          | —     | —       | —       | 銀行             |  |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 9,188 | 8,864   | 9,939   | 149,988        |  |
|   | 銘柄 数 < 比 率 > | 18    | 15      | —       | < 0.4% >       |  |
| (ユーロ…ギリシャ)                              |              |       |         | 千ユーロ    |                |  |
| HELLENIC TELECOM                        | 167          | 167   | 190     | 22,122  | 各種電気通信サービス     |  |
| MOTOR OIL (HELLAS) SA                   | 38           | 38    | 48      | 5,571   | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| OPAP SA                                 | 131          | 131   | 104     | 12,163  | ホテル・レストラン・レジャー |  |
| JUMBO SA                                | 67           | 67    | 96      | 11,159  | 専門小売り          |  |
| TITAN CEMENT CO                         | 25           | —     | —       | —       | 建設資材           |  |
| FF GROUP                                | 20           | 20    | 1       | 226     | 繊維・アパレル・贅沢品    |  |
| NATIONAL BANK OF GREECE                 | —            | 330   | 37      | 4,317   | 銀行             |  |
| TITANCEMENT INTERNATIONAL               | —            | 25    | 29      | 3,464   | 建設資材           |  |
| EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS | —            | 1,620 | 53      | 6,231   | 銀行             |  |
| ALPHA BANK A. E.                        | 764          | 1,140 | 69      | 8,008   | 銀行             |  |
| ユ ー ロ 計                                 | 株 数 ・ 金 額    | 1,214 | 3,540   | 631     | 73,265         |  |
|   | 銘柄 数 < 比 率 > | 7     | 9       | —       | < 0.2% >       |  |
| (チェコ)                                   |              |       |         | 千チェココルナ |                |  |
| KOMERCNI BANKA AS                       | 50           | 50    | 2,651   | 11,294  | 銀行             |  |
| CEZ AS                                  | 95           | 117   | 5,475   | 23,326  | 電力             |  |
| MONETA MONEY BANK AS                    | 273          | 420   | 2,112   | 8,999   | 銀行             |  |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 418   | 587     | 10,239  | 43,620         |  |
|   | 銘柄 数 < 比 率 > | 3     | 3       | —       | < 0.1% >       |  |
| (ハンガリー)                                 |              |       |         | 千フォリント  |                |  |
| OTP BANK NYRT                           | 136          | 144   | 133,200 | 44,209  | 銀行             |  |
| RICHTER GEDEON NYRT                     | 84           | 103   | 71,121  | 23,605  | 医薬品            |  |
| MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC           | 250          | 250   | 51,050  | 16,943  | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 471   | 497     | 255,371 | 84,757         |  |
|   | 銘柄 数 < 比 率 > | 3     | 3       | —       | < 0.2% >       |  |
| (ポーランド)                                 |              |       |         | 千ズロチ    |                |  |
| BANK MILLENNIUM SA                      | 358          | 358   | 82      | 2,101   | 銀行             |  |
| MBANK                                   | 9            | 9     | 169     | 4,321   | 銀行             |  |
| BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA            | 20           | —     | —       | —       | 銀行             |  |
| KGHM POLSKA MIEDZ S. A.                 | 97           | 99    | 762     | 19,438  | 金属・鉱業          |  |
| BANK PEKAO SA                           | 105          | 105   | 525     | 13,388  | 銀行             |  |
| ORANGE POLSKA SA                        | 391          | 391   | 261     | 6,678   | 各種電気通信サービス     |  |

| 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      |                     |
| (ポーランド)                                 | 百株                   | 百株          | 千ズロチ        | 千円          |                     |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY S. A.            | 188                  | 188         | 1,181       | 30,115      | 石油・ガス・消耗燃料          |
| LPP SA                                  | 0.94                 | 0.94        | 597         | 15,232      | 繊維・アパレル・贅沢品         |
| SANTANDER BANK POLSKA SA                | 20                   | 28          | 436         | 11,127      | 銀行                  |
| CD PROJEKT RED SA                       | 40                   | 40          | 1,447       | 36,923      | 娯楽                  |
| PKO BANK POLSKI SA                      | 564                  | 562         | 1,183       | 30,181      | 銀行                  |
| CCC SA                                  | 15                   | 15          | 63          | 1,614       | 繊維・アパレル・贅沢品         |
| GRUPA LOTOS SA                          | 68                   | 68          | 412         | 10,518      | 石油・ガス・消耗燃料          |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I             | 977                  | 977         | 363         | 9,276       | 石油・ガス・消耗燃料          |
| CYFROWY POLSAT SA                       | 189                  | 189         | 467         | 11,913      | メディア                |
| POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA            | 517                  | 517         | 199         | 5,098       | 電力                  |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE            | 375                  | 375         | 1,128       | 28,773      | 保険                  |
| JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S            | 25                   | —           | —           | —           | 金属・鉱業               |
| ALIOR BANK SA                           | 48                   | —           | —           | —           | 銀行                  |
| DINO POLSKA SA                          | 24                   | 38          | 648         | 16,548      | 食品・生活必需品小売り         |
| AMREST HOLDINGS SE                      | —                    | 48          | 119         | 3,047       | ホテル・レストラン・レジャー      |
| 小 計                                     | 株 数<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 4,035<br>20 | 4,012<br>18 | 10,051<br>— | 256,302<br>< 0.7% > |
| (香港)                                    |                      |             | 千香港ドル       |             |                     |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H            | 980                  | 980         | 719         | 9,926       | 金属・鉱業               |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H                | 680                  | 680         | 644         | 8,896       | 運送インフラ              |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES H               | 1,060                | 1,060       | 365         | 5,046       | 旅客航空輸送業             |
| ANGANG STEEL CO LTD-H                   | 580                  | —           | —           | —           | 金属・鉱業               |
| CHINA MOBILE LTD                        | 3,835                | 3,945       | 23,314      | 321,746     | 無線通信サービス            |
| ANHUI CONCH CEMENT CO. LTD-H            | 820                  | 770         | 4,585       | 63,277      | 建設資材                |
| DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H        | 1,660                | 1,660       | 175         | 2,428       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD        | 360                  | 360         | 973         | 13,438      | ガス                  |
| HUANENG POWER INTL INC-H                | 2,380                | 2,380       | 644         | 8,900       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| YANZHOU COAL MINING-H                   | 960                  | 960         | 569         | 7,856       | 石油・ガス・消耗燃料          |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD                | 445                  | 445         | 2,890       | 39,885      | パーソナル用品             |
| HUADIAN POWER INTL CORP-H               | 880                  | 880         | 220         | 3,036       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-H             | 760                  | 760         | 220         | 3,041       | 旅客航空輸送業             |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE             | 2,180                | 2,180       | 1,637       | 22,593      | 自動車                 |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED       | 2,920                | 3,060       | 4,822       | 66,551      | 医薬品                 |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT        | 2,340                | 2,440       | 6,295       | 86,873      | 不動産管理・開発            |
| CHINA RESOURCES LAND LTD                | 1,704                | 2,004       | 6,213       | 85,749      | 不動産管理・開発            |
| CITIC LTD                               | 3,620                | 3,620       | 2,830       | 39,065      | コングロマリット            |
| CHINA TRAVEL INTL INV HK                | 1,180                | —           | —           | —           | ホテル・レストラン・レジャー      |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H | 980                  | 980         | 505         | 6,978       | 運送インフラ              |
| LENOVO GROUP LTD                        | 4,260                | 4,980       | 2,161       | 29,826      | コンピュータ・周辺機器         |
| PETROCHINA CO LTD-H                     | 12,840               | 14,000      | 3,780       | 52,164      | 石油・ガス・消耗燃料          |
| CHINA UNICOM HONGKONG LTD               | 3,780                | 3,780       | 1,882       | 25,977      | 各種電気通信サービス          |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING         | 1,034                | 1,034       | 1,320       | 18,220      | 保険                  |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H            | 16,309               | 16,929      | 6,263       | 86,439      | 石油・ガス・消耗燃料          |
| TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H            | 310                  | —           | —           | —           | 医薬品                 |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H              | 660                  | 660         | 905         | 12,496      | 情報技術サービス            |
| KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD      | 1,420                | 1,420       | 1,658       | 22,888      | ソフトウェア              |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD                 | 496                  | 496         | 4,406       | 60,816      | ガス                  |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD               | 1,860                | 1,860       | 935         | 12,911      | ガス                  |
| TOWNGAS CHINA COMPANY LTD               | 530                  | 530         | 189         | 2,618       | ガス                  |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD                | 1,020                | 1,020       | 415         | 5,728       | 運送インフラ              |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD                  | 3,700                | 3,700       | 536         | 7,403       | 不動産管理・開発            |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING            | 820                  | 820         | 836         | 11,542      | 運送インフラ              |

| 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  |                    |
| (香港)                                   | 百株      | 百株     | 千香港ドル  | 千円      |                    |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H           | 2,100   | 2,100  | 338    | 4,665   | 金属・鉱業              |
| WHARF(HOLDING)                         | —       | 840    | 1,216  | 16,785  | 不動産管理・開発           |
| CHINA EVERBRIGHT LTD                   | 480     | 480    | 569    | 7,856   | 資本市場               |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD                 | 1,174   | 1,756  | 4,908  | 67,730  | ガス                 |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD                 | 430     | 430    | 823    | 11,357  | 電子装置・機器・部品         |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT           | 3,010   | 3,420  | 4,432  | 61,166  | 自動車                |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD                | 1,760   | 1,760  | 432    | 5,974   | 不動産管理・開発           |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT           | 520     | 560    | 2,363  | 32,612  | ガス                 |
| BYD CO LTD-H                           | 440     | 440    | 2,059  | 28,416  | 自動車                |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H               | 8,560   | 8,660  | 2,242  | 30,952  | 各種電気通信サービス         |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H          | 1,000   | 1,000  | 620    | 8,556   | エネルギー設備・サービス       |
| SINOTRANS LIMITED-H                    | 1,110   | 1,110  | 194    | 2,680   | 航空貨物・物流サービス        |
| MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD - H       | 1,340   | 1,340  | 318    | 4,401   | 金属・鉱業              |
| CHINA EVERBRIGHT INTL LTD              | 2,110   | 2,810  | 1,281  | 17,682  | 商業サービス・用品          |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN           | 780     | 780    | 343    | 4,746   | 紙製品・林産品            |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H            | 4,344   | 4,344  | 3,145  | 43,403  | 保険                 |
| AVICHINA INDUSTRY&TECH-H               | 1,120   | 2,020  | 616    | 8,502   | 航空宇宙・防衛            |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDING          | 1,080   | 1,500  | 1,350  | 18,630  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H             | 1,665   | 2,380  | 1,299  | 17,932  | 自動車                |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H              | 4,670   | 4,920  | 7,675  | 105,917 | 保険                 |
| ZIJIN MINING GROUP CO-H                | 3,470   | 3,470  | 1,152  | 15,898  | 金属・鉱業              |
| MMG LTD                                | 1,320   | —      | —      | —       | 金属・鉱業              |
| CHINA ORIENTAL GROUP COMPANY LIMITED   | 860     | —      | —      | —       | 金属・鉱業              |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H           | 1,160   | 1,160  | 1,424  | 19,657  | ヘルスケア機器・用品         |
| WEICHAI POWER CO LTD-H                 | 1,178   | 1,178  | 1,759  | 24,287  | 機械                 |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H | 660     | 660    | 290    | 4,007   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H           | 2,060   | 2,060  | 422    | 5,827   | 化学                 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS           | 300     | 300    | 388    | 5,357   | コングロマリット           |
| SHENZHEN EXPRESSWAY-H                  | —       | 320    | 273    | 3,780   | 運送インフラ             |
| TINGYI (CAYMAN ISLN)HLDG CO            | 1,180   | 1,180  | 1,633  | 22,537  | 食品                 |
| TSING TAO BREWERY CO-H                 | 200     | 240    | 1,219  | 16,824  | 飲料                 |
| GUANGDONG INVESTMENT                   | 1,840   | 1,840  | 2,903  | 40,068  | 水道                 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE     | 1,240   | 1,240  | 421    | 5,818   | 医薬品                |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN            | 873     | 933    | 3,751  | 51,777  | 飲料                 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY-H                  | 1,140   | 1,140  | 702    | 9,690   | 運送インフラ             |
| CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY     | —       | 3,670  | 19     | 268     | 半導体・半導体製造装置        |
| CNOOC LTD                              | 11,090  | 11,710 | 10,222 | 141,075 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL                 | 4,330   | 4,580  | 5,441  | 75,086  | 医薬品                |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO                 | 1,720   | 1,800  | 4,968  | 68,558  | 食品                 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H           | 3,255   | 3,585  | 28,178 | 388,857 | 保険                 |
| LI NING CO LTD                         | —       | 1,360  | 3,563  | 49,172  | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR           | 3,170   | 2,470  | 721    | 9,953   | 水道                 |
| GOME RETAIL HODINGS LTD                | 5,233   | 5,233  | 476    | 6,572   | 専門小売り              |
| CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT  | 2,400   | 2,400  | 379    | 5,232   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AIR CHINA LIMITED-H                    | 1,020   | 1,020  | 521    | 7,192   | 旅客航空輸送業            |
| ZTE CORP-H                             | 580     | 472    | 1,119  | 15,454  | 通信機器               |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H           | 1,260   | 1,260  | 292    | 4,034   | 電気設備               |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO - H            | 2,030   | 2,310  | 3,118  | 43,035  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H     | 1,400   | 1,400  | 298    | 4,115   | 海運業                |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H            | 5,817   | 5,977  | 2,905  | 40,092  | 銀行                 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT           | 1,532   | 1,532  | 950    | 13,112  | 建設・土木              |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H              | 60,360  | 62,080 | 38,241 | 527,729 | 銀行                 |

| 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  |                         |
| (香港)                                     | 百株      | 百株     | 千香港ドル  | 千円      |                         |
| SHENZHO INTERNATIONAL GROUP              | 484     | 501    | 4,576  | 63,157  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H              | 1,840   | 1,840  | 988    | 13,635  | 自動車                     |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD              | 940     | 940    | 832    | 11,493  | 不動産管理・開発                |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS              | 1,010   | 1,010  | 730    | 10,077  | 紙製品・林産品                 |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H             | 2,350   | 2,350  | 2,317  | 31,975  | 建設資材                    |
| BANK OF CHINA LTD-H                      | 49,230  | 50,970 | 14,832 | 204,685 | 銀行                      |
| SHUI ON LAND LTD                         | 1,970   | 1,970  | 265    | 3,670   | 不動産管理・開発                |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD             | 720     | 720    | 2,235  | 30,851  | 不動産管理・開発                |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS                 | 470     | —      | —      | —       | 不動産管理・開発                |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H               | 504     | 800    | 768    | 10,598  | 不動産管理・開発                |
| CHINA MERCHANTS BANK-H                   | 2,501   | 2,531  | 9,279  | 128,056 | 銀行                      |
| IND & COMM BK OF CHINA-H                 | 43,740  | 41,580 | 21,247 | 293,213 | 銀行                      |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H                | 570     | 570    | 528    | 7,299   | 金属・鉱業                   |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING              | 585     | 585    | 445    | 6,143   | 電子装置・機器・部品              |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H | 1,744   | 1,744  | 967    | 13,357  | 建設・土木                   |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H             | 2,990   | 2,990  | 1,509  | 20,837  | 建設・土木                   |
| CHINA COAL ENERGY CO-H                   | 1,120   | 1,120  | 224    | 3,091   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS              | 320     | 320    | 487    | 6,729   | 機械                      |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H            | 363     | 363    | 889    | 12,273  | 電気設備                    |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO               | 870     | 870    | 1,870  | 25,812  | 家庭用耐久財                  |
| CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS              | 1,140   | —      | —      | —       | 食品                      |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO               | 4,873   | 4,943  | 4,943  | 68,224  | 不動産管理・開発                |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H                | 1,800   | 1,800  | 448    | 6,185   | 金属・鉱業                   |
| CHINA CITIC BANK-H                       | 5,600   | 5,600  | 2,116  | 29,211  | 銀行                      |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD                   | 685     | 685    | 794    | 10,965  | 不動産管理・開発                |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD    | 438     | 477    | 5,518  | 76,160  | 電子装置・機器・部品              |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD                 | 670     | 700    | 4,753  | 65,591  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FOSUN INTERNATIONAL LIMITED              | 1,659   | 1,659  | 1,632  | 22,533  | コングロマリット                |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD          | 3,000   | 3,300  | 1,834  | 25,320  | 不動産管理・開発                |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD             | 1,460   | 1,460  | 289    | 3,989   | 不動産管理・開発                |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD                  | —       | 2,040  | 463    | 6,390   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| SOHO CHINA LTD                           | 1,060   | 1,060  | 329    | 4,549   | 不動産管理・開発                |
| KINGSOFT CORP LTD                        | 460     | 460    | 1,297  | 17,901  | ソフトウェア                  |
| SINOTRUK HONG KONG LTD                   | 375     | 375    | 668    | 9,221   | 機械                      |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H                | 2,300   | 2,300  | 1,055  | 14,568  | 建設・土木                   |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD         | 700     | 700    | 570    | 7,872   | 食品                      |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD      | 330     | 330    | 568    | 7,851   | 通信機器                    |
| CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H             | 1,350   | 1,350  | 1,092  | 15,071  | 建設・土木                   |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD             | 2,880   | 3,640  | 2,020  | 27,878  | 食品                      |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H             | 1,720   | 1,722  | 4,218  | 58,220  | 保険                      |
| CRRC CORP LTD-H                          | 2,753   | 2,753  | 1,112  | 15,351  | 機械                      |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD                 | 1,270   | 1,490  | 1,832  | 25,291  | 食品・生活必需品小売り             |
| BBMG CORPORATTON - H                     | 1,270   | 1,270  | 243    | 3,364   | 建設資材                    |
| CHINA ZHONGWANG HOLDING LTD              | 888     | 888    | 149    | 2,058   | 金属・鉱業                   |
| SINOPHARM GROUP CO-H                     | 692     | 872    | 1,818  | 25,090  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD      | 1,520   | 1,520  | 1,596  | 22,024  | 建設資材                    |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-H             | 1,560   | 1,560  | 201    | 2,777   | 建設・土木                   |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H             | 1,998   | 1,998  | 1,469  | 20,274  | 自動車                     |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD                 | 1,670   | 1,040  | 376    | 5,195   | 金属・鉱業                   |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H             | 1,370   | 1,370  | 456    | 6,295   | 銀行                      |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H             | 2,180   | 2,180  | 828    | 11,431  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H               | 509     | 509    | 687    | 9,482   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄                                       | 株数     | 当期     |       |         | 業種等                |
|--|--------|--------|-------|---------|--------------------|
|  |        | 株数     | 期末    |         |                    |
|  |        |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                    |
| (香港)                                     | 百株     | 百株     | 千香港ドル | 千円      |                    |
| HUANENG RENEWABLES CORP-H                | 3,800  | —      | —     | —       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS              | 1,550  | —      | —     | —       | 医薬品                |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD                 | 1,480  | 1,540  | 5,197 | 71,725  | 不動産管理・開発           |
| YUZHOU PROPERTIES CO LTD                 | 910    | 910    | 310   | 4,282   | 不動産管理・開発           |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H                | —      | 610    | 396   | 5,471   | 機械                 |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD               | 980    | 1,165  | 4,252 | 58,681  | 不動産管理・開発           |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H             | 474    | 591    | 1,598 | 22,061  | 保険                 |
| CHINA MINSHENG BANKING-H                 | 4,198  | 4,808  | 2,711 | 37,421  | 銀行                 |
| KAISA GROUP HLDS LTD                     | 1,150  | 1,150  | 343   | 4,745   | 不動産管理・開発           |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H              | 399    | 399    | 306   | 4,226   | 電気設備               |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H             | 1,340  | 2,570  | 806   | 11,136  | 銀行                 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H             | 18,480 | 18,870 | 6,038 | 83,329  | 銀行                 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS                | 310    | 310    | 1,035 | 14,288  | 専門小売り              |
| FAR EAST HORIZON LTD                     | 1,540  | 1,540  | 974   | 13,452  | 各種金融サービス           |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H                | 1,490  | 1,230  | 1,781 | 24,578  | 資本市場               |
| SEAZEN GROUP LTD                         | 960    | 1,680  | 1,229 | 16,970  | 不動産管理・開発           |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING             | 810    | 810    | 787   | 10,865  | 医薬品                |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H              | 2,172  | 1,736  | 1,161 | 16,027  | 資本市場               |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-RTS            | 77     | —      | —     | —       | 資本市場               |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC            | 450    | 450    | 1,757 | 24,250  | 電子装置・機器・部品         |
| PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H             | 5,870  | 5,870  | 1,490 | 20,575  | 保険                 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H             | 345    | 345    | 948   | 13,092  | 医薬品                |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD               | 1,960  | 1,960  | 1,140 | 15,741  | 不動産管理・開発           |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H              | 715    | 715    | 258   | 3,561   | 建設・土木              |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H             | 2,660  | 2,660  | 1,034 | 14,279  | 資本市場               |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD             | 430    | 430    | 189   | 2,616   | 自動車部品              |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD           | —      | 480    | 530   | 7,326   | 建設関連製品             |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD      | 1,440  | 1,440  | —     | —       | 食品                 |
| CHINA DING YI FENG HOLDINGS LT           | 560    | —      | —     | —       | 資本市場               |
| GREENTOWN SER                            | 600    | 600    | 633   | 8,743   | 商業サービス・用品          |
| JIAYUAN INTL GROUP LTD                   | 540    | —      | —     | —       | 不動産管理・開発           |
| CHINA EVERGRANDE GROUP                   | 1,580  | 1,260  | 1,857 | 25,629  | 不動産管理・開発           |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD           | 326    | 620    | 652   | 9,000   | 資本市場               |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H           | 5,460  | 5,400  | 2,451 | 33,832  | 銀行                 |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD          | 280    | 280    | 1,843 | 25,444  | 食品                 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP                   | 720    | 560    | 833   | 11,499  | ライフサイエンス・ツール/サービス  |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING              | 1,760  | 1,890  | 3,220 | 44,443  | 半導体・半導体製造装置        |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD             | 920    | 720    | 2,624 | 36,216  | 商業サービス・用品          |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD              | —      | 670    | 322   | 4,456   | 不動産管理・開発           |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | —      | 232    | 2,514 | 34,705  | ヘルスケア・テクノロジー       |
| CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD            | 1,720  | —      | —     | —       | 自動車部品              |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS           | —      | 250    | 329   | 4,547   | 各種消費者サービス          |
| A-LIVING SERVICES CO LTD                 | —      | 330    | 1,407 | 19,422  | 商業サービス・用品          |
| CHINA TOWER CORP LTD                     | 25,400 | 27,900 | 4,743 | 65,453  | 各種電気通信サービス         |
| XIAOMI CORPORATION                       | 2,360  | 6,510  | 7,291 | 100,618 | コンピュータ・周辺機器        |
| WUXI APPTTEC CO LTD                      | —      | 95     | 1,052 | 14,525  | ライフサイエンス・ツール/サービス  |
| MEITUAN DIANPING B                       | 254    | 647    | 7,220 | 99,643  | インターネット販売・通信販売     |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.      | —      | 240    | 818   | 11,293  | ホテル・レストラン・レジャー     |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD                 | 1,620  | 2,620  | 1,441 | 19,885  | 半導体・半導体製造装置        |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD-RTS             | 162    | —      | —     | —       | 半導体・半導体製造装置        |
| INNOVENT BIOLOGICS INC                   | —      | 585    | 2,231 | 30,798  | バイオテクノロジー          |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H             | 6,200  | 6,200  | 930   | 12,834  | 資本市場               |

| 銘柄                                       | 株数      | 当 期 末   |         |           | 業 種 等                |  |
|--|---------|---------|---------|-----------|----------------------|--|
|  |         | 株数      | 評 価 額   |           |                      |  |
|  |         |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                      |  |
| (香港)                                     | 百株      | 百株      | 千香港ドル   | 千円        |                      |  |
| LOGAN PROPERTY HLDS CO LTD               | 740     | 740     | 886     | 12,233    | 不動産管理・開発             |  |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS             | 995     | 995     | 3,462   | 47,783    | 機械                   |  |
| CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD          | —       | 980     | 908     | 12,536    | 不動産管理・開発             |  |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDING             | —       | 190     | 238     | 3,293     | 各種消費者サービス            |  |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD             | —       | 770     | 712     | 9,829     | 専門小売り                |  |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED  | 495     | 790     | 1,196   | 16,505    | 運送インフラ               |  |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP              | —       | 300     | 916     | 12,647    | 医薬品                  |  |
| TENCENT HOLDINGS LTD                     | 3,565   | 3,679   | 153,855 | 2,123,209 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| CHINA VANKE CO LTD-H                     | 813     | 993     | 2,502   | 34,532    | 不動産管理・開発             |  |
| LUYE PHARMA GROUP LTD                    | 625     | 625     | 233     | 3,217     | 医薬品                  |  |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD               | 8,700   | 8,700   | 870     | 12,006    | 娯楽                   |  |
| CAR INC                                  | 410     | —       | —       | —         | 陸運・鉄道                |  |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD               | 260     | 260     | 434     | 5,991     | 半導体・半導体製造装置          |  |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD        | 3,670   | —       | —       | —         | 半導体・半導体製造装置          |  |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT | 2,120   | 2,320   | 4,231   | 58,397    | ヘルスケア・テクノロジー         |  |
| CGN POWER CO LTD-H                       | 6,270   | 6,270   | 1,141   | 15,747    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者   |  |
| FULLSHARE HOLDINGS LIMITED               | 3,900   | —       | —       | —         | 電気設備                 |  |
| BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED           | 960     | 960     | 336     | 4,636     | 自動車                  |  |
| GF SECURITIES CO LTD-H                   | 826     | 826     | 680     | 9,392     | 資本市場                 |  |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD        | 392     | 392     | 699     | 9,650     | 自動車部品                |  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H               | 922     | 1,020   | 1,289   | 17,792    | 資本市場                 |  |
| 3SBIO, INC                               | 770     | 770     | 656     | 9,053     | バイオテクノロジー            |  |
| LEGEND HLDS CORP                         | 181     | 181     | 155     | 2,148     | コンピュータ・周辺機器          |  |
| LEGEND HLDS CORP-RTS                     | —       | 181     | —       | —         | コンピュータ・周辺機器          |  |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 930     | 930     | 444     | 6,134     | 医薬品                  |  |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD    | 5,920   | 5,920   | 509     | 7,025     | 資本市場                 |  |
| CHINA LITERATURE LTD                     | 208     | 208     | 777     | 10,735    | メディア                 |  |
| SSY GROUP LTD                            | 820     | 820     | 456     | 6,303     | 医薬品                  |  |
| DALI FOODS GROUP CO LTD                  | 1,115   | 1,115   | 526     | 7,262     | 食品                   |  |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H             | 800     | 800     | 298     | 4,117     | 電子装置・機器・部品           |  |
| CHINA REINSURANCE GROUP CO-H             | 3,080   | 3,080   | 271     | 3,740     | 保険                   |  |
| MEITU INC                                | 1,060   | —       | —       | —         | コンピュータ・周辺機器          |  |
| BOC AVIATION LTD                         | 113     | 113     | 553     | 7,633     | 商社・流通業               |  |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H           | 89      | 250     | 712     | 9,832     | 保険                   |  |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H     | 564     | 924     | 1,125   | 15,530    | 資本市場                 |  |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC                | 290     | 485     | 6,052   | 83,528    | ライフサイエンス・ツール/サービス    |  |
| HENGTE NETWORKS GROUP LTD                | 12,160  | —       | —       | —         | インターネット販売・通信販売       |  |
| 小 計                                      | 株数・金額   | 574,459 | 575,922 | 615,132   | 8,488,834            |  |
|  | 銘柄数<比率> | 208     | 208     | —         | <23.0%>              |  |
| (マレーシア)                                  |         |         |         | 千リンギ      |                      |  |
| AMMB HOLDING                             | 1,250   | 1,250   | 363     | 8,977     | 銀行                   |  |
| GENTING PLANTATIONS BHD                  | 146     | 146     | 135     | 3,351     | 食品                   |  |
| CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD               | 2,890   | 2,800   | 963     | 23,771    | 銀行                   |  |
| DIGI.COM BERHAD                          | 2,200   | 1,860   | 833     | 20,565    | 無線通信サービス             |  |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD              | 564     | 564     | 276     | 6,827     | 運送インフラ               |  |
| RHB BANK BHD                             | 800     | 1,250   | 582     | 14,378    | 銀行                   |  |
| HAP SENG CONSOLIDATED                    | 338     | 338     | 242     | 5,989     | コングロマリット             |  |
| GAMUDA BERHAD                            | 1,002   | 1,002   | 335     | 8,284     | 建設・土木                |  |
| YTL CORPORATION                          | 2,108   | 2,108   | 156     | 3,850     | 総合公益事業               |  |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP               | 134     | 134     | 172     | 4,246     | 銀行                   |  |
| HONG LEONG BANK                          | 374     | 374     | 501     | 12,388    | 銀行                   |  |
| IJM CORP                                 | 1,526   | 1,526   | 256     | 6,327     | 建設・土木                |  |

| 銘柄                                | 株数      | 当 期 末  |        |        |                         | 業 種 等 |
|-----------------------------------|---------|--------|--------|--------|-------------------------|-------|
|                                   |         | 株数     | 評 価 額  |        | 業 種 等                   |       |
|                                   |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額 |                         |       |
| (マレーシア)                           | 百株      | 百株     | 千リンギ   | 千円     |                         |       |
| KUALA LUMPUR KEPONG               | 264     | 264    | 543    | 13,421 | 食品                      |       |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD       | 77      | 77     | 242    | 5,993  | 飲料                      |       |
| MALAYAN BANKING                   | 2,460   | 2,460  | 1,822  | 44,988 | 銀行                      |       |
| ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD        | 548     | —      | —      | —      | 銀行                      |       |
| MISC BHD                          | 690     | 999    | 789    | 19,489 | 海運業                     |       |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD          | 36      | 44     | 608    | 15,007 | 食品                      |       |
| PPB GROUP BERHAD                  | 350     | 350    | 569    | 14,044 | 食品                      |       |
| PETRONAS DAGANGAN BHD             | 145     | 145    | 297    | 7,336  | 石油・ガス・消耗燃料              |       |
| PETRONAS GAS BERHAD               | 468     | 437    | 649    | 16,026 | ガス                      |       |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD      | 78      | —      | —      | —      | タバコ                     |       |
| TELEKOM MALAYSIA                  | 620     | 620    | 263    | 6,503  | 各種電気通信サービス              |       |
| SP SETIA BHD                      | 875     | —      | —      | —      | 不動産管理・開発                |       |
| TENAGA NASIONAL                   | 1,923   | 2,090  | 2,579  | 63,651 | 電力                      |       |
| QL RESOURCES BHD                  | 400     | 400    | 324    | 7,996  | 食品                      |       |
| DIALOG GROUP BHD                  | 2,193   | 2,193  | 719    | 17,755 | エネルギー設備・サービス            |       |
| PUBLIC BANK BHD                   | 1,827   | 2,039  | 3,210  | 79,230 | 銀行                      |       |
| ATRASIA GROUP BHD                 | 866     | 866    | 67     | 1,656  | 旅客航空輸送業                 |       |
| TOP GLOVE CORP BHD                | 842     | 842    | 615    | 15,190 | ヘルスケア機器・用品              |       |
| CARLSBERG BREWERY MALAYSIA BERHAD | —       | 95     | 262    | 6,485  | 飲料                      |       |
| GENTING BHD                       | 1,240   | 1,120  | 464    | 11,471 | ホテル・レストラン・レジャー          |       |
| GENTING MALAYSIA BHD              | 1,632   | 2,290  | 545    | 13,451 | ホテル・レストラン・レジャー          |       |
| IOI CORP                          | 1,167   | 1,167  | 452    | 11,175 | 食品                      |       |
| SIME DARBY BERHAD                 | 1,228   | 2,200  | 433    | 10,696 | コングロマリット                |       |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD            | 744     | 1,210  | 891    | 22,008 | ヘルスケア機器・用品              |       |
| AXIATA GROUP BERHAD               | 1,950   | 1,950  | 758    | 18,721 | 無線通信サービス                |       |
| MAXIS BHD                         | 1,462   | 1,462  | 770    | 19,015 | 無線通信サービス                |       |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD      | 1,630   | 1,440  | 789    | 19,475 | 化学                      |       |
| IHH HEALTHCARE BHD                | 1,640   | 1,560  | 804    | 19,866 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |       |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD            | 514     | 514    | 188    | 4,642  | 運送インフラ                  |       |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS    | 811     | 811    | 313    | 7,725  | 金属・鉱業                   |       |
| SIME DARBY PROPERTY BHD           | 2,500   | —      | —      | —      | 不動産管理・開発                |       |
| SIME DARBY PLANTATION BHD         | 1,443   | 1,443  | 688    | 16,987 | 食品                      |       |
| IOI PROPERTIES GROUP BHD          | 705     | —      | —      | —      | 不動産管理・開発                |       |
| 小 計                               | 株数・金額   | 46,664 | 44,444 | 25,485 | 628,973                 |       |
|                                   | 銘柄数<比率> | 44     | 40     | —      | <1.7%>                  |       |
| (タイ)                              |         |        |        | 千バーツ   |                         |       |
| BANGKOK BANK (F)                  | 135     | 286    | 2,738  | 9,119  | 銀行                      |       |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR       | 737     | 737    | 2,708  | 9,019  | 食品・生活必需品小売り             |       |
| KRUNG THAI BANK-NVDR              | 2,670   | 2,670  | 2,750  | 9,159  | 銀行                      |       |
| RATCH GROUP PCL-NVDR              | —       | 430    | 2,848  | 9,486  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |       |
| ROBINSON PCL -NVDR                | 261     | —      | —      | —      | 複合小売り                   |       |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR       | 1,098   | 508    | 3,378  | 11,249 | 銀行                      |       |
| TRUE CORP PCL-NVDR                | 5,972   | 9,200  | 2,962  | 9,864  | 各種電気通信サービス              |       |
| KASIKORN BANK PCL-NVDR            | 370     | 373    | 3,114  | 10,371 | 銀行                      |       |
| TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR         | 6,494   | 10,989 | 989    | 3,293  | 銀行                      |       |
| IRPC PCL - NVDR                   | 5,279   | 9,000  | 2,376  | 7,912  | 石油・ガス・消耗燃料              |       |
| BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR          | 1,220   | 2,630  | 1,446  | 4,816  | 石油・ガス・消耗燃料              |       |
| ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR   | 67      | 173    | 4,653  | 15,496 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |       |
| INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR       | —       | 1,400  | 7,420  | 24,708 | 無線通信サービス                |       |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR       | 2,132   | 2,790  | 7,602  | 25,317 | 食品                      |       |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR        | 646     | 742    | 14,357 | 47,811 | 無線通信サービス                |       |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR      | 2,425   | 3,545  | 4,716  | 15,704 | 専門小売り                   |       |

| 銘柄                                    | 株数      | 当期     |        | 期末       |                         | 業種等 |
|---------------------------------------|---------|--------|--------|----------|-------------------------|-----|
|                                       |         | 株数     | 株数     | 評価額      |                         |     |
|                                       |         |        |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額                  |     |
| (タイ)                                  | 百株      | 百株     | 千バーツ   | 千円       |                         |     |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR           | 307     | —      | —      | —        | 電子装置・機器・部品              |     |
| PTT PCL-NVDR                          | 6,650   | 7,590  | 26,754 | 89,093   | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR             | 1,128   | 1,998  | 2,517  | 8,383    | 食品                      |     |
| LAND & HOUSES PUB - NVDR              | 1,623   | 6,200  | 4,061  | 13,523   | 不動産管理・開発                |     |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR                  | 228     | 506    | 17,001 | 56,615   | 建設資材                    |     |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR         | 2,750   | 2,570  | 15,355 | 51,134   | 運送インフラ                  |     |
| KASIKORN BANK PCL(F)                  | 720     | 720    | 6,012  | 20,019   | 銀行                      |     |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR              | 759     | 1,339  | 6,125  | 20,399   | 不動産管理・開発                |     |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR          | 2,800   | 6,510  | 12,564 | 41,839   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR           | 208     | 322    | 3,606  | 12,009   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR          | 1,630   | 1,630  | 3,097  | 10,313   | ホテル・レストラン・レジャー          |     |
| THAI OIL PCL-NVDR                     | 830     | 830    | 3,589  | 11,953   | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| GLOW ENERGY PCL - NVDR                | 261     | —      | —      | —        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| CP ALL PCL-NVDR                       | 3,110   | 3,750  | 27,000 | 89,910   | 食品・生活必需品小売り             |     |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR           | 3,116   | 4,760  | 5,569  | 18,545   | 陸運・鉄道                   |     |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR            | 864     | 864    | 7,171  | 23,880   | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR           | —       | 430    | 1,720  | 5,727    | 無線通信サービス                |     |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR            | 1,109   | 1,109  | 3,023  | 10,069   | 化学                      |     |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR          | 1,519   | 1,519  | 5,851  | 19,486   | 化学                      |     |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR              | 950     | 950    | 3,586  | 11,942   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR        | 4,471   | 4,471  | 4,180  | 13,920   | 運送インフラ                  |     |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR                | —       | 340    | 1,462  | 4,868    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR          | 330     | 1,650  | 6,270  | 20,879   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| OSOTSPA PCL-NVDR                      | —       | 330    | 1,344  | 4,478    | 飲料                      |     |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR          | —       | 1,480  | 5,365  | 17,868   | 複合小売り                   |     |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR                | —       | 320    | 1,624  | 5,407    | 消費者金融                   |     |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR            | 490     | 490    | 2,205  | 7,342    | 消費者金融                   |     |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR             | —       | 330    | 2,244  | 7,472    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| 小計                                    | 株数・金額   | 65,362 | 98,484 | 243,367  | 810,413                 |     |
|                                       | 銘柄数<比率> | 36     | 41     | —        | <2.2%>                  |     |
| (フィリピン)                               |         |        |        | 千フィリピンペソ |                         |     |
| AYALA LAND LTD                        | 4,413   | 4,990  | 16,292 | 34,539   | 不動産管理・開発                |     |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC           | 1,460   | 1,460  | 5,591  | 11,854   | コングロマリット                |     |
| BANK OF PHILIPPINE ISLANDS            | 535     | 535    | 3,055  | 6,476    | 銀行                      |     |
| ALLIANCE GLOBAL GROUP INC             | 2,189   | —      | —      | —        | コングロマリット                |     |
| DMCI HOLDINGS INC                     | 1,780   | —      | —      | —        | コングロマリット                |     |
| GLOBE TELECOM INC                     | 20      | 20     | 4,450  | 9,435    | 無線通信サービス                |     |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS | 690     | 690    | 5,727  | 12,141   | 運送インフラ                  |     |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC                | 1,737   | 1,737  | 8,554  | 18,136   | コングロマリット                |     |
| JOLLIBEE FOODS CORPORATION            | 244     | 244    | 3,318  | 7,035    | ホテル・レストラン・レジャー          |     |
| METROPOLITAN BANK & TRUST             | 1,130   | 1,276  | 4,692  | 9,948    | 銀行                      |     |
| MEGAWORLD CORP                        | 5,580   | 9,100  | 2,356  | 4,996    | 不動産管理・開発                |     |
| ROBINSONS LAND CO                     | 928     | 1,320  | 1,966  | 4,169    | 不動産管理・開発                |     |
| SECURITY BANK CORP                    | 120     | 120    | 1,207  | 2,559    | 銀行                      |     |
| SM PRIME HLDGS                        | 6,699   | 6,529  | 20,242 | 42,913   | 不動産管理・開発                |     |
| UNIVERSAL ROBINA CORP                 | 508     | 670    | 8,241  | 17,470   | 食品                      |     |
| SM INVESTMENTS CORP                   | 163     | 168    | 13,507 | 28,635   | コングロマリット                |     |
| AYALA CORPORATION                     | 170     | 207    | 14,574 | 30,897   | コングロマリット                |     |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CO          | 7,478   | 7,478  | 2,138  | 4,534    | 各種金融サービス                |     |
| ABOITIZ POWER CORP                    | 767     | 767    | 2,032  | 4,309    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| MANTILA ELECTRIC COMPANY              | 169     | 169    | 4,258  | 9,028    | 電力                      |     |
| BDO UNIBANK INC                       | 1,249   | 1,249  | 12,124 | 25,704   | 銀行                      |     |

| 銘柄                              | 株数           | 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               |       |
| (フィリピン)                         | 百株           | 百株      | 千フィリピンペソ   | 千円         |                      |       |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC         | 50           | 54      | 2,252      | 4,775      | コングロマリット             |       |
| PLDT INC                        | 49           | 49      | 5,998      | 12,717     | 無線通信サービス             |       |
| 小 計                             | 株 数 ・ 金 額    | 38,133  | 38,837     | 142,584    | 302,279              |       |
|                                 | 銘柄 数 < 比 率 > | 23      | 21         | —          | < 0.8% >             |       |
| (インドネシア)                        |              |         |            | 千ルピア       |                      |       |
| BARITO PACIFIC TBK PT           | —            | 16,600  | 2,008,600  | 14,261     | 化学                   |       |
| UNITED TRACTORS TBK PT          | 991          | 991     | 1,569,048  | 11,140     | 石油・ガス・消耗燃料           |       |
| INDOFOOD SUKSES MAK TBK         | 2,662        | 2,662   | 1,763,575  | 12,521     | 食品                   |       |
| PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA   | 4,990        | 4,990   | 2,180,630  | 15,482     | 食品                   |       |
| GUDANG GARAM TBK                | 292          | 292     | 1,286,260  | 9,132      | タバコ                  |       |
| HM SAMPOERNA TBK PT             | 6,400        | 6,400   | 1,049,600  | 7,452      | タバコ                  |       |
| INDOCEMENT TUNGAL PRAKARSA      | 1,012        | 1,360   | 1,441,600  | 10,235     | 建設資材                 |       |
| INDAH KIAT PULP&PAPER           | 1,486        | 1,486   | 757,860    | 5,380      | 紙製品・林産品              |       |
| BUKIT ASAM TBK PT               | 2,200        | 2,200   | 453,200    | 3,217      | 石油・ガス・消耗燃料           |       |
| BANK MANDIRI                    | 11,420       | 11,070  | 4,649,400  | 33,010     | 銀行                   |       |
| PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA       | 1,000        | 1,000   | 482,000    | 3,422      | 紙製品・林産品              |       |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT       | 891          | 5,235   | 4,214,175  | 29,920     | 家庭用品                 |       |
| BANK RAKYAT INDONESIA           | 35,700       | 35,360  | 9,158,240  | 65,023     | 銀行                   |       |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT    | 5,935        | 5,935   | 510,410    | 3,623      | ガス                   |       |
| BANK NEGARA INDONESIA PT        | 4,990        | 4,990   | 1,896,200  | 13,463     | 銀行                   |       |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT  | 1,760        | 1,760   | 1,311,200  | 9,309      | 建設資材                 |       |
| BANK CENTRAL ASIA               | 6,310        | 6,380   | 16,731,550 | 118,794    | 銀行                   |       |
| XL AXIATA TBK PT                | —            | 1,600   | 380,800    | 2,703      | 無線通信サービス             |       |
| JASA MARGA (PERSERO) TBK PT     | 1,135        | 1,135   | 413,354    | 2,934      | 運送インフラ               |       |
| BUMI SERPONG DAMAI PT           | 4,283        | 4,283   | 284,819    | 2,022      | 不動産管理・開発             |       |
| ADARO ENERGY PT                 | 8,392        | 8,392   | 860,180    | 6,107      | 石油・ガス・消耗燃料           |       |
| PAKUWON JATI TBK PT             | 9,200        | 9,200   | 327,520    | 2,325      | 不動産管理・開発             |       |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T    | 1,040        | 1,780   | 1,713,250  | 12,164     | 食品                   |       |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE    | 887          | —       | —          | —          | 各種電気通信サービス           |       |
| BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT     | 2,080        | 2,080   | 175,760    | 1,247      | 銀行                   |       |
| KALBE FARMA PT                  | 15,400       | 15,400  | 2,156,000  | 15,307     | 医薬品                  |       |
| ACE HARDWARE INDONESIA          | —            | 3,000   | 408,000    | 2,896      | 専門小売り                |       |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK      | 12,860       | 13,350  | 4,992,900  | 35,449     | 自動車                  |       |
| SURYA CITRA MEDIA PT TBK        | 3,455        | —       | —          | —          | メディア                 |       |
| TELEKOMUNIKASI                  | 30,800       | 33,200  | 10,590,800 | 75,194     | 各種電気通信サービス           |       |
| 小 計                             | 株 数 ・ 金 額    | 177,572 | 202,132    | 73,766,933 | 523,745              |       |
|                                 | 銘柄 数 < 比 率 > | 27      | 28         | —          | < 1.4% >             |       |
| (韓国)                            |              |         |            | 千ウォン       |                      |       |
| CHEIL WORLDWIDE INC             | 33           | 59      | 104,430    | 9,168      | メディア                 |       |
| HANMI SCIENCE CO LTD            | 7            | —       | —          | —          | 医薬品                  |       |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD    | 26           | 26      | 153,648    | 13,490     | 自動車                  |       |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE | 18           | 18      | 352,485    | 30,948     | 保険                   |       |
| DB INSURANCE CO LTD             | 28           | 28      | 128,677    | 11,297     | 保険                   |       |
| COWAY CO LTD                    | 33           | 33      | 206,412    | 18,122     | 家庭用耐久財               |       |
| KT & G CORP                     | 74           | 72      | 572,936    | 50,303     | タバコ                  |       |
| S-1 CORPORATION                 | 8            | 14      | 123,540    | 10,846     | 商業サービス・用品            |       |
| KOREA GAS CORPORATION           | 15           | 15      | 43,812     | 3,846      | ガス                   |       |
| CJ CORP                         | 11           | 11      | 88,000     | 7,726      | コングロマリット             |       |
| KAKAO CORP                      | 30           | 35      | 727,180    | 63,846     | インタラクティブ・メディアおよびサービス |       |
| CJ ENM CO LTD                   | 6            | 6       | 79,168     | 6,950      | インターネット販売・通信販売       |       |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE    | 29           | 29      | 50,025     | 4,392      | 機械                   |       |
| KMW CO.LTD.                     | —            | 11      | 71,478     | 6,275      | 通信機器                 |       |

| 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  |                      |
| (韓国)                                     | 百株      | 百株  | 千ウォン      | 千円      |                      |
| SK TELECOM CO LTD                        | 12      | 12  | 262,890   | 23,081  | 無線通信サービス             |
| DAELIM INDUSTRIAL COMPANY                | 16      | 16  | 130,080   | 11,421  | 建設・土木                |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD                | 247     | 247 | 139,764   | 12,271  | 資本市場                 |
| NCSOFT CORPORATION                       | 11      | 10  | 735,357   | 64,564  | 娯楽                   |
| LG UPLUS CORP                            | 64      | 133 | 174,230   | 15,297  | 各種電気通信サービス           |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTR              | 96      | 96  | 34,593    | 3,037   | 建設・土木                |
| POSCO INTERNATIONAL CORP                 | 39      | 39  | 54,990    | 4,828   | 商社・流通業               |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE               | 5       | 5   | 829,280   | 72,810  | パーソナル用品              |
| LG CHEMICALS LTD                         | 28      | 29  | 1,046,925 | 91,920  | 化学                   |
| LG CHEM LTD - PREFERRED                  | 3       | 3   | 61,440    | 5,394   | 化学                   |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF               | 1       | 1   | 73,112    | 6,419   | パーソナル用品              |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP                  | 268     | 286 | 859,430   | 75,457  | 銀行                   |
| S-OIL CORPORATION                        | 26      | 26  | 185,610   | 16,296  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| HANWHA SOLUTIONS CORP                    | 63      | 63  | 90,519    | 7,947   | 化学                   |
| MERITZ SECURITIES                        | —       | 245 | 79,380    | 6,969   | 資本市場                 |
| SAMSUNG SECURITIES                       | 35      | 35  | 103,206   | 9,061   | 資本市場                 |
| POSCO CHEMICAL CO LTD                    | 18      | 18  | 94,120    | 8,263   | 建設資材                 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION               | 10      | 10  | 205,275   | 18,023  | 化学                   |
| HOTEL SHILLA CO LTD                      | 16      | 19  | 161,308   | 14,162  | 専門小売り                |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN | 23      | 23  | 194,200   | 17,050  | 機械                   |
| HYUNDAI MOBIS                            | 44      | 44  | 788,480   | 69,228  | 自動車部品                |
| SK HYNIX INC                             | 368     | 349 | 2,970,750 | 260,831 | 半導体・半導体製造装置          |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR             | 46      | 46  | 162,750   | 14,289  | 建設・土木                |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD                 | 14      | 14  | 82,173    | 7,214   | 自動車                  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD                     | 87      | 99  | 943,110   | 82,805  | 自動車                  |
| HYUNDAI STEEL CO                         | 47      | 47  | 101,553   | 8,916   | 金属・鉱業                |
| INDUSTRIAL BK OF KOREA                   | 150     | 150 | 116,409   | 10,220  | 銀行                   |
| KCC CORP                                 | 3       | 2   | 40,950    | 3,595   | 化学                   |
| KIA MOTORS CORP                          | 157     | 164 | 500,200   | 43,917  | 自動車                  |
| KOREA ZINC CO LTD                        | 5       | 5   | 221,704   | 19,465  | 金属・鉱業                |
| KOREA ELECTRIC POWER                     | 153     | 148 | 330,780   | 29,042  | 電力                   |
| HANWHA CORPORATION                       | 24      | 24  | 47,424    | 4,163   | コングロマリット             |
| KOREAN AIR LINES CO LTD                  | 25      | 25  | 49,459    | 4,342   | 旅客航空輸送業              |
| OCI COMPANY LTD                          | 8       | 15  | 64,780    | 5,687   | 化学                   |
| CJ LOGISTICS                             | 3       | 7   | 112,320   | 9,861   | 陸運・鉄道                |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO                  | 9       | 9   | 71,955    | 6,317   | 化学                   |
| KT CORP                                  | 8       | —   | —         | —       | 各種電気通信サービス           |
| HLB INC                                  | 25      | 18  | 183,732   | 16,131  | レジャー用品               |
| HLB INC RTS                              | —       | 1   | 3,949     | 346     | レジャー用品               |
| LG ELECTRONICS INC                       | 69      | 61  | 339,480   | 29,806  | 家庭用耐久財               |
| LOTTE CORP                               | 16      | 16  | 62,775    | 5,511   | コングロマリット             |
| LG CORP                                  | 60      | 60  | 372,680   | 32,721  | コングロマリット             |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD        | 77      | 77  | 73,821    | 6,481   | 資本市場                 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT               | 42      | 42  | 105,711   | 9,281   | 建設・土木                |
| NAVER CORP                               | 88      | 91  | 1,966,660 | 172,672 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HYUNDAI DEPT STORE CO                    | 11      | 11  | 80,712    | 7,086   | 複合小売り                |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO             | 22      | 31  | 152,290   | 13,371  | 資本市場                 |
| OTTOGI CORPORATION                       | 0.7     | 0.7 | 37,590    | 3,300   | 食品                   |
| AMOREPACIFIC GROUP                       | 15      | 15  | 87,704    | 7,700   | パーソナル用品              |
| KANGWON LAND INC                         | 79      | 79  | 196,710   | 17,271  | ホテル・レストラン・レジャー       |
| POSCO                                    | 49      | 50  | 907,200   | 79,652  | 金属・鉱業                |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD               | 85      | 85  | 99,258    | 8,714   | 建設・土木                |

| 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    |                   |
| (韓国)                                     | 百株      | 百株    | 千ウォン       | 千円        |                   |
| SAMSUNG SDI CO,LTD                       | 35      | 34    | 979,265    | 85,979    | 電子装置・機器・部品        |
| SAMSUNG ELECTRO MECHANICS                | 33      | 34    | 415,310    | 36,464    | 電子装置・機器・部品        |
| SAMSUNG ELECTRONICS                      | 2,988   | 3,073 | 14,996,240 | 1,316,669 | コンピュータ・周辺機器       |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES                 | 307     | 307   | 130,782    | 11,482    | 機械                |
| SAMSUNG ELECTRONICS PFD                  | 522     | 524   | 2,186,208  | 191,949   | コンピュータ・周辺機器       |
| SHINSEGAE CO LTD                         | 4       | 4     | 108,244    | 9,503     | 複合小売り             |
| YUHAN CORPORATION                        | 6       | 36    | 177,923    | 15,621    | 医薬品               |
| HANON SYSTEMS                            | 116     | 116   | 103,335    | 9,072     | 自動車部品             |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO             | 34      | 34    | 89,080     | 7,821     | 保険                |
| GS HOLDINGS CORP                         | 36      | 36    | 138,240    | 12,137    | 石油・ガス・消耗燃料        |
| LG.DISPLAY CO LTD                        | 162     | 162   | 176,580    | 15,503    | 電子装置・機器・部品        |
| CELLTRON INC                             | 50      | 60    | 1,281,945  | 112,554   | バイオテクノロジー         |
| HELIXMITH CO LTD                         | 9       | 15    | 101,250    | 8,889     | バイオテクノロジー         |
| HANA FINANCIAL HOLDINGS                  | 180     | 201   | 539,685    | 47,384    | 銀行                |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD                    | 11      | 11    | 116,280    | 10,209    | 航空貨物・物流サービス       |
| CELLTRON PHARM INC                       | 8       | —     | —          | —         | 医薬品               |
| LOTTE SHOPPING CO                        | 8       | 8     | 74,880     | 6,574     | 複合小売り             |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO                | 46      | 46    | 221,096    | 19,412    | 保険                |
| AMOREPACIFIC CORP                        | 21      | 19    | 350,295    | 30,755    | パーソナル用品           |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF                   | 4       | 4     | 25,748     | 2,260     | パーソナル用品           |
| SAMSUNG CARD CO                          | 13      | 13    | 41,004     | 3,600     | 消費者金融             |
| SK INNOVATION CO LTD                     | 39      | 35    | 352,988    | 30,992    | 石油・ガス・消耗燃料        |
| CJ CHEILJEDANG CORP                      | 5       | 5     | 141,270    | 12,403    | 食品                |
| PAN OCEAN CO LTD                         | 148     | 148   | 49,583     | 4,353     | 海運業               |
| LG INNOTEK CO LTD                        | 8       | 8     | 118,250    | 10,382    | 電子装置・機器・部品        |
| SK HOLDINGS CO LTD                       | 18      | 23    | 427,050    | 37,494    | コングロマリット          |
| KB FINANCIAL GROUP INC                   | 249     | 255   | 838,040    | 73,579    | 銀行                |
| MEDY-TOX INC                             | 2       | 2     | 35,519     | 3,118     | バイオテクノロジー         |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES               | 45      | 45    | 108,706    | 9,544     | 航空宇宙・防衛           |
| BNK FINANCIAL GROUP INC                  | 128     | 228   | 110,922    | 9,738     | 銀行                |
| HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD            | 4       | 4     | 132,756    | 11,655    | 医薬品               |
| HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD             | 132     | 132   | 22,576     | 1,982     | 保険                |
| FILA HOLDINGS CORP                       | 34      | 29    | 98,887     | 8,682     | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| E-MART CO                                | 11      | 11    | 135,224    | 11,872    | 食品・生活必需品小売り       |
| DGB FINANCIAL GROUP INC                  | 83      | —     | —          | —         | 銀行                |
| GS RETAIL CO LTD                         | 11      | 11    | 42,921     | 3,768     | 食品・生活必需品小売り       |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO             | 53      | 53    | 119,168    | 10,462    | 自動車部品             |
| HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E             | 15      | 23    | 44,161     | 3,877     | 建設・土木             |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD | 5       | 5     | 149,250    | 13,104    | 機械                |
| BGF RETAIL CO LTD /NEW                   | 4       | 4     | 72,992     | 6,408     | 食品・生活必需品小売り       |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA             | 11      | 18    | 223,200    | 19,596    | 食品                |
| ORANGE LIFE INSURANCE LTD                | 16      | —     | —          | —         | 保険                |
| NETMARBLE CORP                           | 14      | 14    | 143,766    | 12,622    | 娯楽                |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC                | 299     | 388   | 313,116    | 27,491    | 銀行                |
| CJ CORP-CONVERT PREF                     | 1       | —     | —          | —         | コングロマリット          |
| SAMSUNG SDS CO LTD                       | 23      | 24    | 432,960    | 38,013    | 情報技術サービス          |
| SAMSUNG C&T CORP                         | 47      | 57    | 601,350    | 52,798    | コングロマリット          |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD                 | 10      | 10    | 602,112    | 52,865    | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| PEARL ABYSS CORP                         | 3       | 3     | 65,100     | 5,715     | 娯楽                |
| DOOSAN BOBCAT INC                        | 33      | 33    | 77,887     | 6,838     | 機械                |
| SILLAJEN INC                             | 37      | —     | —          | —         | バイオテクノロジー         |

| 銘柄                                  | 株数      | 当期    |         |            | 業種等                     |
|-------------------------------------|---------|-------|---------|------------|-------------------------|
|                                     |         | 株数    | 期末      |            |                         |
|                                     |         |       | 評価額     | 金額         |                         |
| (韓国)                                | 百株      | 百株    | 千ウォン    | 千円         |                         |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD         | 33      | 35    | 308,088 | 27,050     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| 小計                                  | 株数・金額   | 9,256 | 9,846   | 47,513,812 | 4,171,712               |
|                                     | 銘柄数<比率> | 115   | 111     | —          | <11.3%>                 |
| (台湾)                                |         |       | 千新台幣ドル  |            |                         |
| ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION       | —       | 320   | 6,704   | 24,000     | 通信機器                    |
| ACER INC                            | 1,607   | 1,607 | 2,628   | 9,410      | コンピュータ・周辺機器             |
| ASUSTEK COMPUTER INC                | 418     | 458   | 9,183   | 32,878     | コンピュータ・周辺機器             |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP          | 284     | 284   | 7,118   | 25,484     | 半導体・半導体製造装置             |
| ASIA CEMENT                         | 1,269   | 1,269 | 5,587   | 20,001     | 建設資材                    |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP              | 180     | 180   | 3,663   | 13,113     | 電子装置・機器・部品              |
| TAIWAN BUSINESS BANK                | 3,053   | 3,206 | 3,398   | 12,166     | 銀行                      |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI         | 690     | 690   | 4,857   | 17,390     | 半導体・半導体製造装置             |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD     | 520     | 520   | 4,721   | 16,903     | コンピュータ・周辺機器             |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD          | 296     | 486   | 3,877   | 13,879     | コンピュータ・周辺機器             |
| QUANTA COMPUTER INC                 | 1,756   | 1,756 | 11,401  | 40,818     | コンピュータ・周辺機器             |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP        | 391     | 391   | 1,713   | 6,132      | 不動産管理・開発                |
| EVA AIRWAYS CORP                    | 1,756   | 1,809 | 1,981   | 7,092      | 旅客航空輸送業                 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD           | 408     | 408   | 9,862   | 35,309     | コンピュータ・周辺機器             |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK           | 3,781   | 3,417 | 6,459   | 23,126     | 銀行                      |
| CHINA AIRLINES                      | 1,335   | 1,335 | 1,043   | 3,734      | 旅客航空輸送業                 |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD        | 1,070   | 1,530 | 5,180   | 18,545     | 自動車部品                   |
| CHINA STEEL                         | 7,625   | 7,545 | 14,826  | 53,079     | 金属・鉄業                   |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD         | 1,622   | 1,767 | 3,552   | 12,718     | 保険                      |
| ADVANTECH CO.,LTD.                  | 215     | 215   | 6,283   | 22,496     | コンピュータ・周辺機器             |
| COMPAL ELECTRONICS                  | 2,445   | 2,445 | 4,598   | 16,461     | コンピュータ・周辺機器             |
| DELTA ELECTRONICS INC               | 1,296   | 1,236 | 17,315  | 61,988     | 電子装置・機器・部品              |
| NANYA TECHNOLOGY CO                 | 590     | 630   | 4,019   | 14,389     | 半導体・半導体製造装置             |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD             | 2,330   | 2,420 | 26,627  | 95,325     | 各種電気通信サービス              |
| AU OPTRONICS CORP                   | 4,890   | 4,890 | 3,613   | 12,937     | 電子装置・機器・部品              |
| TAIWAN MOBILE CO LTD                | 952     | 1,022 | 10,986  | 39,331     | 無線通信サービス                |
| EVERGREEN MARINE                    | 911     | 2,023 | 2,135   | 7,643      | 海運業                     |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 2,264   | 2,294 | 6,252   | 22,384     | コングロマリット                |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD          | 203     | 223   | 3,653   | 13,079     | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD           | 114     | 114   | 3,129   | 11,204     | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD        | 340     | 340   | 6,930   | 24,812     | 半導体・半導体製造装置             |
| FORMOSA PLASTIC                     | 2,784   | 2,974 | 25,697  | 91,996     | 化学                      |
| FORMOSA TAFFETA CO.                 | 650     | 650   | 2,184   | 7,818      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO           | 2,149   | 2,189 | 16,140  | 57,781     | 化学                      |
| GIANT MANUFACTURING                 | 187     | 187   | 3,525   | 12,620     | レジャー用品                  |
| MEDIATEK INC                        | 945     | 945   | 38,902  | 139,270    | 半導体・半導体製造装置             |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD      | 4,345   | 4,255 | 17,298  | 61,927     | 保険                      |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C        | 4,640   | 4,893 | 9,321   | 33,370     | 銀行                      |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD             | 160     | 180   | 9,324   | 33,379     | 専門小売り                   |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD         | 1,050   | 1,050 | 7,035   | 25,185     | 無線通信サービス                |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO         | 6,723   | 6,193 | 10,157  | 36,364     | 各種金融サービス                |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD     | 5,185   | 4,970 | 19,508  | 69,840     | 保険                      |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING | 8,387   | 8,387 | 7,532   | 26,965     | 保険                      |
| E. SUN FINANCIAL HOLDINGS CO        | 6,147   | 6,584 | 17,678  | 63,289     | 銀行                      |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY          | 8,176   | 8,006 | 61,009  | 218,413    | 電子装置・機器・部品              |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT        | 6,613   | 7,113 | 21,341  | 76,402     | 銀行                      |
| LARGAN PRECISTON CO LTD             | 60      | 60    | 25,519  | 91,358     | 電子装置・機器・部品              |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS          | 6,442   | 6,647 | 8,209   | 29,391     | 銀行                      |

| 銘柄                                     | 株数      | 当 期 末   |         |           | 業 種 等       |  |
|--|---------|---------|---------|-----------|-------------|--|
|  |         | 株数      | 評 価 額   |           |             |  |
|  |         |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |             |  |
| (台湾)                                   | 百株      | 百株      | 千新台幣ドル  | 千円        |             |  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS           | 6,768   | 7,082   | 5,871   | 21,018    | 保険          |  |
| INVENTEC CO.,LTD                       | 1,369   | 1,369   | 3,210   | 11,493    | コンピュータ・周辺機器 |  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP                | 1,458   | 1,458   | 6,849   | 24,522    | コンピュータ・周辺機器 |  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS             | 7,485   | 7,415   | 8,564   | 30,662    | 銀行          |  |
| CTBC FINANCIAL HOLDING                 | 11,392  | 12,362  | 24,476  | 87,627    | 銀行          |  |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO             | 6,116   | 6,177   | 13,436  | 48,103    | 銀行          |  |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC               | 461     | 461     | 4,891   | 17,511    | 半導体・半導体製造装置 |  |
| NAN YA PLASTICS CORP                   | 3,337   | 3,407   | 21,806  | 78,067    | 化学          |  |
| WISTRON CORP                           | 1,564   | 2,164   | 5,941   | 21,271    | コンピュータ・周辺機器 |  |
| POU CHEN CORP                          | 1,354   | 1,354   | 3,759   | 13,458    | 繊維・アパレル・贅沢品 |  |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO           | 2,968   | 3,008   | 21,329  | 76,358    | 食品          |  |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP             | 348     | 378     | 11,533  | 41,291    | 食品・生活必需品小売り |  |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP             | 723     | 883     | 7,802   | 27,931    | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| PHISON ELECTRONICS CORP                | 93      | 93      | 2,689   | 9,628     | 半導体・半導体製造装置 |  |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD             | 310     | 310     | 1,362   | 4,878     | 不動産管理・開発    |  |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD                 | 202     | 202     | 1,374   | 4,920     | 繊維・アパレル・贅沢品 |  |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD              | 548     | 548     | 3,081   | 11,032    | 電子装置・機器・部品  |  |
| STANDARD FOODS CORP                    | 270     | 270     | 1,776   | 6,359     | 食品          |  |
| SYNEX TECHNOLOGY INTL CORP             | 775     | 775     | 3,052   | 10,926    | 電子装置・機器・部品  |  |
| TAIWAN CEMENT                          | 2,769   | 3,293   | 14,162  | 50,703    | 建設資材        |  |
| TATUNG CO LTD                          | 1,300   | 1,300   | 2,834   | 10,145    | 家庭用耐久財      |  |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR                   | 15,370  | 15,810  | 470,347 | 1,683,844 | 半導体・半導体製造装置 |  |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP           | 7,045   | 7,045   | 11,025  | 39,471    | 半導体・半導体製造装置 |  |
| WINBOND ELECTRONICS CORPORATION        | 2,420   | 2,420   | 3,267   | 11,695    | 半導体・半導体製造装置 |  |
| YAGEO CORPORATION                      | 143     | 143     | 5,801   | 20,768    | 電子装置・機器・部品  |  |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP            | 1,480   | 1,430   | 4,790   | 17,149    | 運送インフラ      |  |
| INNOLUX CORP                           | 5,053   | 5,053   | 3,163   | 11,324    | 電子装置・機器・部品  |  |
| WPG HOLDINGS CO LTD                    | 1,153   | 1,203   | 4,634   | 16,592    | 電子装置・機器・部品  |  |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP                | 128     | 132     | 3,840   | 13,748    | 機械          |  |
| TAIMED BIOLOGICS INC                   | 110     | —       | —       | —         | バイオテクノロジー   |  |
| PEGATRON CORP                          | 1,216   | 1,216   | 8,068   | 28,884    | コンピュータ・周辺機器 |  |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP             | 60      | 80      | 4,488   | 16,067    | 機械          |  |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP                | 210     | 210     | 5,911   | 21,163    | 半導体・半導体製造装置 |  |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD               | 709     | 730     | 8,254   | 29,552    | 各種金融サービス    |  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING           | 364     | 364     | 4,259   | 15,250    | 電子装置・機器・部品  |  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL           | 5,546   | 5,713   | 11,340  | 40,599    | 銀行          |  |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK | 2,110   | 2,205   | 9,617   | 34,428    | 銀行          |  |
| WIWYNN CORP                            | —       | 50      | 3,970   | 14,212    | コンピュータ・周辺機器 |  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD          | 2,176   | 2,176   | 14,713  | 52,674    | 半導体・半導体製造装置 |  |
| GLOBALWAFERS CO LTD                    | 130     | 130     | 4,953   | 17,731    | 半導体・半導体製造装置 |  |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD            | 100     | 100     | 2,310   | 8,269     | 家庭用耐久財      |  |
| 小 計                                    | 株数・金額   | 206,420 | 212,666 | 1,258,257 | 4,504,563   |  |
|  | 銘柄数<比率> | 87      | 88      | —         | <12.2%>     |  |
| (インド)                                  |         |         |         | 千インドルピー   |             |  |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED            | 1,795   | 1,823   | 284,716 | 404,296   | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD              | 447     | 447     | 14,517  | 20,615    | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| EICHER MOTORS LTD                      | 8       | 8       | 11,364  | 16,137    | 自動車         |  |
| MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED              | 439     | 508     | 19,644  | 27,894    | 自動車         |  |
| SHREE CEMENT LIMITED                   | 4       | 4       | 8,804   | 12,502    | 建設資材        |  |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP               | 343     | 343     | 6,771   | 9,615     | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| LTC HOUSING FINANCE                    | 180     | 180     | 4,758   | 6,757     | 貯蓄・抵当・不動産金融 |  |
| TATA STEEL LIMITED                     | 186     | 186     | 5,077   | 7,210     | 金属・鉱業       |  |

| 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  |                      |
| (インド)                                 | 百株      | 百株    | 千インドルピー | 千円      |                      |
| NESTLE INDIA LIMITED                  | 15      | 15    | 27,594  | 39,184  | 食品                   |
| GAIL INDIA LTD                        | 549     | 946   | 8,641   | 12,271  | ガス                   |
| VEDANTA LTD                           | 805     | 1,260 | 9,752   | 13,848  | 金属・鉱業                |
| TITAN CO LTD                          | 178     | 210   | 17,489  | 24,835  | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| OIL&NATURAL GAS CORP LTD              | 1,570   | 1,570 | 11,932  | 16,943  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)             | —       | 29    | 3,942   | 5,598   | パーソナル用品              |
| LUPIN LTD                             | 149     | 149   | 12,441  | 17,666  | 医薬品                  |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE           | 1,030   | 1,050 | 177,418 | 251,934 | 貯蓄・抵当・不動産金融          |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE          | 275     | 700   | 10,545  | 14,974  | メディア                 |
| INFOSYS LTD                           | 2,165   | 2,186 | 147,380 | 209,279 | 情報技術サービス             |
| WIPRO LTD                             | 1,001   | 804   | 14,793  | 21,006  | 情報技術サービス             |
| INDIAN OIL CORPORATION LTD            | 1,300   | 1,130 | 8,401   | 11,930  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED            | 417     | 536   | 111,994 | 159,032 | 家庭用品                 |
| HCL TECHNOLOGIES LTD                  | 348     | 696   | 36,080  | 51,234  | 情報技術サービス             |
| DABUR INDIA LTD                       | 378     | 378   | 16,889  | 23,982  | パーソナル用品              |
| HERO MOTOCORP LTD                     | 35      | 62    | 12,187  | 17,306  | 自動車                  |
| DR. REDDYS LABORATORIES               | 65      | 71    | 28,405  | 40,336  | 医薬品                  |
| BHARTI AIRTEL LIMITED                 | 920     | 1,542 | 81,733  | 116,061 | 無線通信サービス             |
| BHARTI AIRTEL LIMITED-RTS             | 260     | —     | —       | —       | 無線通信サービス             |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD          | 492     | 601   | 28,186  | 40,025  | 医薬品                  |
| DIVIS LABORATORIES LTD                | 59      | 59    | 13,574  | 19,276  | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD               | 64      | 70    | 32,858  | 46,658  | 自動車                  |
| GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD          | 68      | —     | —       | —       | 医薬品                  |
| AUROBINDO PHARMA LTD                  | 187     | 187   | 12,204  | 17,330  | 医薬品                  |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD            | 574     | 574   | 4,422   | 6,280   | 自動車部品                |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE             | 89      | 52    | 3,870   | 5,496   | 消費者金融                |
| PETRONET LNG LTD                      | 349     | 349   | 7,858   | 11,158  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| CIPLA LIMITED                         | 209     | 209   | 12,418  | 17,633  | 医薬品                  |
| LARSEN&TOUBRO LIMITED                 | 312     | 311   | 25,376  | 36,033  | 建設・土木                |
| ULTRATECH CEMENT LTD                  | 61      | 61    | 20,429  | 29,010  | 建設資材                 |
| ASHOK LEYLAND LIMITED                 | 606     | 606   | 2,853   | 4,052   | 機械                   |
| BOSCH LTD                             | 3       | 3     | 3,818   | 5,422   | 自動車部品                |
| TATA CONSULTANCY SVS LTD              | 572     | 591   | 111,899 | 158,897 | 情報技術サービス             |
| NTPC LIMITED                          | 1,420   | 1,420 | 12,354  | 17,543  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者   |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD               | 47      | 79    | 7,021   | 9,970   | 医薬品                  |
| AMBUJA CEMENTS LTD                    | 299     | 299   | 5,066   | 7,195   | 建設資材                 |
| BHARAT FORGE LIMITED                  | 127     | 127   | 3,553   | 5,045   | 自動車部品                |
| HINDALCO INDUSTRIES LIMITED           | 717     | 717   | 8,404   | 11,934  | 金属・鉱業                |
| ITC LTD                               | 2,164   | 2,211 | 34,989  | 49,684  | タバコ                  |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD               | 66      | 66    | 9,058   | 12,863  | 化学                   |
| UPL LTD                               | 244     | 321   | 11,703  | 16,619  | 化学                   |
| SIEMENS LIMITED                       | —       | 31    | 3,234   | 4,592   | コングロマリット             |
| INFO EDGE INDIA LTD                   | —       | 29    | 8,039   | 11,416  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD          | 201     | 272   | 13,587  | 19,294  | パーソナル用品              |
| VODAFONE IDEA LTD                     | 3,761   | —     | —       | —       | 無線通信サービス             |
| MARICO LIMITED                        | 263     | 263   | 7,908   | 11,230  | パーソナル用品              |
| PAGE INDUSTRIES LTD                   | 3       | 3     | 5,774   | 8,199   | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| DLF LIMITED                           | —       | 260   | 3,383   | 4,805   | 不動産管理・開発             |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD          | 1,060   | 1,270 | 20,193  | 28,674  | 電力                   |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 320     | 426   | 12,143  | 17,243  | 運送インフラ               |
| REC LTD                               | 398     | 398   | 3,485   | 4,949   | 各種金融サービス             |
| BAJAJ FINSERV LTD                     | 23      | 23    | 10,674  | 15,157  | 保険                   |

| 銘柄                                      | 株数      | 株数     | 期末      |           | 業種等            |  |
|---|---------|--------|---------|-----------|----------------|--|
|   |         |        | 評価額     |           |                |  |
|   |         |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                |  |
| (インド)                                   | 百株      | 百株     | 千インドルピー | 千円        |                |  |
| BAJAJ AUTO LIMITED                      | 55      | 55     | 13,522  | 19,201    | 自動車            |  |
| COAL INDIA LTD                          | 769     | 769    | 9,920   | 14,086    | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| TATA MOTORS LTD                         | 1,040   | 1,040  | 8,429   | 11,969    | 自動車            |  |
| TATA POWER COMPANY LIMITED              | 638     | 638    | 1,820   | 2,584     | 電力             |  |
| MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS            | 151     | 151    | 2,506   | 3,559     | 消費者金融          |  |
| BHARTI INFRATEL LTD                     | 165     | 165    | 2,876   | 4,085     | 各種電気通信サービス     |  |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD          | 170     | —      | —       | —         | 貯蓄・抵当・不動産金融    |  |
| ASIAN PAINTS LTD                        | 170     | 193    | 30,463  | 43,257    | 化学             |  |
| BAJAJ FINANCE LTD                       | 103     | 111    | 22,528  | 31,990    | 消費者金融          |  |
| YES BANK LTD                            | 1,148   | —      | —       | —         | 銀行             |  |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD              | —       | 320    | 16,641  | 23,631    | 保険             |  |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD            | —       | 19     | 5,212   | 7,401     | 資本市場           |  |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD             | 123     | 123    | 4,441   | 6,306     | 陸運・鉄道          |  |
| BANDHAN BANK LTD                        | —       | 289    | 6,936   | 9,849     | 銀行             |  |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD                | 40      | 45     | 13,565  | 19,263    | 食品             |  |
| AXIS BANK LIMITED                       | 1,214   | 1,404  | 53,639  | 76,168    | 銀行             |  |
| HAVELLS INDIA LTD                       | 177     | 177    | 8,627   | 12,251    | 電気設備           |  |
| ICICI BANK LTD                          | 1,510   | 3,145  | 106,206 | 150,813   | 銀行             |  |
| BERGER PAINTS INDIA LTD                 | —       | 190    | 8,652   | 12,286    | 化学             |  |
| TECH MAHINDRA LTD                       | 320     | 283    | 15,174  | 21,547    | 情報技術サービス       |  |
| CADILA HEALTHCARE LTD                   | 88      | —      | —       | —         | 医薬品            |  |
| GRASIM INDUSTRIES LIMITED               | 216     | 177    | 8,607   | 12,222    | 建設資材           |  |
| AVENUE SUPERMARTS LTD                   | 67      | 78     | 17,589  | 24,976    | 食品・生活必需品小売り    |  |
| UNITED SPIRITS LTD                      | 156     | 226    | 11,330  | 16,089    | 飲料             |  |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY | —       | 102    | 12,598  | 17,889    | 保険             |  |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD  | —       | 171    | 6,841   | 9,715     | 保険             |  |
| INTERGLOBE AVIATION LTD                 | 50      | 50     | 4,649   | 6,602     | 旅客航空輸送業        |  |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD               | —       | 196    | 14,896  | 21,153    | 保険             |  |
| JSW STEEL LTD                           | 465     | 530    | 8,938   | 12,692    | 金属・鉱業          |  |
| 小計                                      | 株数・金額   | 38,478 | 39,383  | 1,970,247 | 2,797,751      |  |
|   | 銘柄数<比率> | 78     | 83      | —         | <7.6%>         |  |
| (パキスタン)                                 |         |        |         | 千パキスタンルピー |                |  |
| MCB BANK LIMITED                        | 219     | 340    | 5,292   | 3,598     | 銀行             |  |
| OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD            | 510     | 510    | 5,255   | 3,573     | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| HABIB BANK LTD                          | 356     | 356    | 3,402   | 2,313     | 銀行             |  |
| 小計                                      | 株数・金額   | 1,085  | 1,206   | 13,950    | 9,486          |  |
|   | 銘柄数<比率> | 3      | 3       | —         | <0.0%>         |  |
| (メキシコ)                                  |         |        |         | 千メキシコペソ   |                |  |
| ALFA S. A. B. -A                        | 1,721   | 1,721  | 1,677   | 7,601     | コングロマリット       |  |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD            | 1,182   | 1,187  | 18,982  | 85,990    | 飲料             |  |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL-CI               | 108     | 108    | 656     | 2,976     | 複合小売り          |  |
| GRUPO TELEVISIA SAB - SER CPO           | 1,534   | 1,534  | 3,773   | 17,094    | メディア           |  |
| GRUPO BIMBO SAB-SERIES A                | 905     | 1,010  | 3,484   | 15,784    | 食品             |  |
| GRUMA S. A. B. -B                       | 134     | 134    | 3,309   | 14,992    | 食品             |  |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INF            | 129     | 129    | 2,195   | 9,947     | 運送インフラ         |  |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1            | 349     | 349    | 1,675   | 7,591     | コングロマリット       |  |
| CEMEX SAB - CPO                         | 8,869   | 8,619  | 4,413   | 19,992    | 建設資材           |  |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O              | 1,637   | 1,673  | 12,654  | 57,325    | 銀行             |  |
| MEXICHEM SAB DE CV-*                    | 604     | —      | —       | —         | 化学             |  |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV            | 84      | 84     | 1,537   | 6,964     | 金属・鉱業          |  |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A              | 795     | 950    | 3,278   | 14,851    | 家庭用品           |  |
| ALSEA SAB DE CV                         | 300     | 300    | 602     | 2,728     | ホテル・レストラン・レジャー |  |

| 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  |                |         |
| (メキシコ)                                 | 百株      | 百株     | 千メキシコペソ | 千円      |                |         |
| GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B           | 143     | 143    | 3,587   | 16,249  | 運送インフラ         |         |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B          | 2,299   | 2,299  | 12,168  | 55,122  | 金属・鉱業          |         |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L           | 21,420  | 21,710 | 32,782  | 148,502 | 無線通信サービス       |         |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O             | 1,402   | 1,402  | 2,038   | 9,234   | 銀行             |         |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV             | 261     | 261    | 2,624   | 11,889  | 飲料             |         |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH           | 214     | 214    | 3,320   | 15,041  | 運送インフラ         |         |
| MEGACABLE HOLDINGS-CPO                 | 231     | 231    | 1,561   | 7,071   | メディア           |         |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N           | 387     | 387    | 2,918   | 13,221  | ガス             |         |
| BANCO SANTANDER MEXICO SA INSTITUCION  | 1,320   | —      | —       | —       | 銀行             |         |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV           | —       | 604    | 1,925   | 8,722   | 化学             |         |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV              | 324     | 324    | 3,105   | 14,068  | 飲料             |         |
| WALMART DE MEXICO-SER V                | 3,380   | 3,410  | 19,979  | 90,505  | 食品・生活必需品小売り    |         |
| 小 計                                    | 株 数     | 金 額    | 49,735  | 48,786  | 144,254        | 653,473 |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                          | 25      | 24     | —       | <1.8%>  |                |         |
| (ブラジル)                                 |         |        | 千リアル    |         |                |         |
| BRF SA                                 | 327     | 397    | 743     | 13,882  | 食品             |         |
| VALE SA                                | 1,959   | 2,022  | 9,878   | 184,332 | 金属・鉱業          |         |
| TIM PARTICIPACOES SA                   | 465     | 465    | 612     | 11,431  | 無線通信サービス       |         |
| CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B | 118     | 180    | 457     | 8,531   | 電力             |         |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER           | 111     | 165    | 366     | 6,841   | 電力             |         |
| BANCO DO BRASIL SA                     | 523     | 536    | 1,452   | 27,104  | 銀行             |         |
| ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR           | 2,785   | 2,840  | 2,411   | 44,994  | 銀行             |         |
| LOJAS AMERICANAS SA-PREF               | 504     | 504    | 1,358   | 25,344  | 複合小売り          |         |
| GERDAU SA PFD NPV                      | 561     | 745    | 968     | 18,072  | 金属・鉱業          |         |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICIAO        | —       | 111    | 730     | 13,632  | 食品・生活必需品小売り    |         |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS              | 1,857   | 2,333  | 4,561   | 85,108  | 石油・ガス・消耗燃料     |         |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA             | 190     | 436    | 830     | 15,498  | 専門小売り          |         |
| PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR             | 2,440   | 2,790  | 5,155   | 96,209  | 石油・ガス・消耗燃料     |         |
| KROTON EDUCACIONAL SA                  | 834     | —      | —       | —       | 各種消費者サービス      |         |
| CCR SA                                 | 690     | 756    | 863     | 16,110  | 運送インフラ         |         |
| WEG SA                                 | 519     | 519    | 1,985   | 37,050  | 電気設備           |         |
| BANCO BRADESCO SA - PREF               | 2,550   | 2,873  | 5,149   | 96,081  | 銀行             |         |
| BANCO BRADESCO S. A.                   | 741     | 937    | 1,559   | 29,093  | 銀行             |         |
| NATURA COSMETICOS SA                   | 142     | —      | —       | —       | パーソナル用品        |         |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA            | 462     | 462    | 393     | 7,336   | 金属・鉱業          |         |
| SUZANO SA                              | 329     | 329    | 1,560   | 29,121  | 紙製品・林産品        |         |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF          | 2,992   | 3,121  | 6,968   | 130,024 | 銀行             |         |
| PORTO SEGURO SA                        | 70      | 70     | 284     | 5,309   | 保険             |         |
| BRASKEM SA-PREF A                      | 121     | 121    | 246     | 4,601   | 化学             |         |
| LOCALIZA RENT A CAR                    | 385     | 377    | 1,119   | 20,891  | 陸運・鉄道          |         |
| LOJAS RENNER S. A.                     | 510     | 495    | 1,681   | 31,372  | 複合小売り          |         |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES                 | 480     | 480    | 666     | 12,432  | 石油・ガス・消耗燃料     |         |
| COSAN SA                               | 91      | 91     | 566     | 10,577  | 石油・ガス・消耗燃料     |         |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD            | 100     | 500    | 880     | 16,420  | 電力             |         |
| EMBRAER SA                             | 410     | 410    | 309     | 5,768   | 航空宇宙・防衛        |         |
| M DIAS BRANCO SA                       | 55      | —      | —       | —       | 食品             |         |
| B2W CIA DIGITAL                        | 135     | 135    | 1,181   | 22,042  | インターネット販売・通信販売 |         |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA              | 467     | 467    | 382     | 7,128   | 不動産管理・開発       |         |
| JBS SA                                 | 657     | 746    | 1,749   | 32,643  | 食品             |         |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF       | 600     | 600    | 518     | 9,666   | 電力             |         |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP            | 190     | 213    | 873     | 16,295  | 水道             |         |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS              | 176     | 176    | 331     | 6,187   | 不動産管理・開発       |         |

| 銘柄                                    | 株数      | 株数     | 期末      |           | 業種等                     |  |
|---------------------------------------|---------|--------|---------|-----------|-------------------------|--|
|                                       |         |        | 評価額     |           |                         |  |
|                                       |         |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                         |  |
| (ブラジル)                                | 百株      | 百株     | 千レアル    | 千円        |                         |  |
| SUL AMERICA SA - UNITS                | 91      | 181    | 787     | 14,701    | 保険                      |  |
| HYPERA SA                             | 239     | 239    | 671     | 12,531    | 医薬品                     |  |
| TELEFONICA BRASIL-PREF                | 304     | 268    | 1,291   | 24,103    | 各種電気通信サービス              |  |
| MAGAZINE LUIZA SA                     | 41      | 460    | 2,554   | 47,673    | 複合小売り                   |  |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) SA           | 244     | 244    | 596     | 11,123    | 銀行                      |  |
| ENERGISA SA-UNITS                     | —       | 102    | 416     | 7,769     | 電力                      |  |
| CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF          | 111     | —      | —       | —         | 食品・生活必需品小売り             |  |
| CIELO SA                              | 737     | 737    | 277     | 5,175     | 情報技術サービス                |  |
| RAIA DROGASIL SA                      | 135     | 157    | 1,643   | 30,667    | 食品・生活必需品小売り             |  |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES           | 441     | 441    | 1,026   | 19,149    | 保険                      |  |
| ENGIE BRASIL SA                       | 120     | 120    | 458     | 8,560     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |  |
| NOTRE DAME INTERMED PAR SA            | —       | 303    | 1,687   | 31,487    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS | —       | 139    | 703     | 13,124    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC          | 190     | 296    | 584     | 10,908    | 食品・生活必需品小売り             |  |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO             | 1,320   | 1,361  | 5,140   | 95,919    | 資本市場                    |  |
| AMBEV SA                              | 3,010   | 3,089  | 3,719   | 69,412    | 飲料                      |  |
| COGNA EDUCACAO                        | —       | 1,039  | 491     | 9,175     | 各種消費者サービス               |  |
| KLABIN SA-UNIT                        | 427     | 427    | 917     | 17,122    | 容器・包装                   |  |
| NATURA &CO HOLDING SA                 | —       | 409    | 1,460   | 27,246    | パーソナル用品                 |  |
| RUMO SA                               | 706     | 706    | 1,433   | 26,743    | 陸運・鉄道                   |  |
| IRB BRASIL RESSEGUROS SA              | 100     | 447    | 404     | 7,540     | 保険                      |  |
| BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT           | —       | 161    | 602     | 11,241    | 資本市場                    |  |
| 小計                                    | 株数・金額   | 33,770 | 38,736  | 85,665    | 1,598,517               |  |
|                                       | 銘柄数<比率> | 52     | 55      | —         | <4.3%>                  |  |
| (チリ)                                  |         |        |         | 千チリペソ     |                         |  |
| BANCO DE CREDITO E INVERSION          | 29      | 30     | 88,539  | 11,448    | 銀行                      |  |
| EMPRESAS CMPC SA                      | 719     | 719    | 123,395 | 15,955    | 紙製品・林産品                 |  |
| EMPRESAS COPEC SA                     | 259     | 259    | 132,090 | 17,079    | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| EMPRESA NACIONAL DE TELECOM           | 89      | 89     | 44,070  | 5,698     | 無線通信サービス                |  |
| COLBUN SA                             | 4,710   | 4,710  | 54,212  | 7,009     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |  |
| AGUAS ANDINAS SA-A                    | 2,080   | 2,160  | 57,287  | 7,407     | 水道                      |  |
| EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B           | 288     | 288    | 55,872  | 7,224     | 飲料                      |  |
| S. A. C. I. FALABELLA                 | 510     | 502    | 120,731 | 15,610    | 複合小売り                   |  |
| CENCOSUD SA                           | 807     | 807    | 76,466  | 9,887     | 食品・生活必需品小売り             |  |
| 小計                                    | 株数・金額   | 9,493  | 9,566   | 752,665   | 97,319                  |  |
|                                       | 銘柄数<比率> | 9      | 9       | —         | <0.3%>                  |  |
| (コロンビア)                               |         |        |         | 千コロンビアペソ  |                         |  |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA            | 334     | 338    | 601,640 | 16,545    | 電力                      |  |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF        | 70      | —      | —       | —         | 各種金融サービス                |  |
| GRUPO AVAL ACCIONES-PFD               | 2,057   | 2,057  | 165,588 | 4,553     | 銀行                      |  |
| CEMENTOS ARGOS SA                     | 276     | —      | —       | —         | 建設資材                    |  |
| GRUPO ARGOS SA                        | 156     | 156    | 138,528 | 3,809     | 建設資材                    |  |
| BANCOLOMBIA SA                        | 159     | 159    | 381,600 | 10,494    | 銀行                      |  |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA             | 130     | 130    | 265,460 | 7,300     | 各種金融サービス                |  |
| 小計                                    | 株数・金額   | 3,182  | 2,840   | 1,552,816 | 42,702                  |  |
|                                       | 銘柄数<比率> | 7      | 5       | —         | <0.1%>                  |  |
| (アラブ首長国連邦)                            |         |        |         | 千UAEディルハム |                         |  |
| DUBAI ISLAMIC BANK                    | 1,020   | 1,020  | 348     | 10,143    | 銀行                      |  |
| EMIRATES TELECOM CORPORATION          | 1,125   | 1,125  | 1,662   | 48,336    | 各種電気通信サービス              |  |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK             | 1,738   | 1,738  | 712     | 20,723    | 銀行                      |  |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC             | 1,618   | 1,732  | 2,009   | 58,405    | 銀行                      |  |
| EMAAR PROPERTIES PJSC                 | 2,016   | 2,620  | 639     | 18,583    | 不動産管理・開発                |  |

| 銘柄                             | 株数         | 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   |                         |
| (アラブ首長国連邦)                     | 百株         | 百株      |        | 千UAEディルハム | 千円       |                         |
| ALDAR PROPERTIES PJSC          | 2,770      | 2,770   | 476    | 13,850    |          | 不動産管理・開発                |
| EMAAR DEVELOPMENT PJSC         | 434        | —       | —      | —         |          | 不動産管理・開発                |
| EMAAR MALLS PJSC               | 897        | 2,110   | 240    | 6,992     |          | 不動産管理・開発                |
| DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC | 1,009      | —       | —      | —         |          | 不動産管理・開発                |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額  | 12,629  | 13,115 | 6,089     | 177,034  |                         |
|                                | 銘柄数 < 比率 > | 9       | 7      | —         | < 0.5% > |                         |
| (エジプト)                         |            |         |        | 千エジプトポンド  |          |                         |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK  | 780        | 913     | 5,859  | 39,786    |          | 銀行                      |
| EASTERN TOBACCO                | 515        | 515     | 620    | 4,212     |          | タバコ                     |
| ELSWEDY ELECTRIC CO            | 415        | 415     | 337    | 2,293     |          | 電気設備                    |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額  | 1,710   | 1,843  | 6,817     | 46,292   |                         |
|                                | 銘柄数 < 比率 > | 3       | 3      | —         | < 0.1% > |                         |
| (南アフリカ)                        |            |         |        | 千ランド      |          |                         |
| BIDVEST GROUP LTD              | 219        | 172     | 2,491  | 14,524    |          | コングロマリット                |
| CLICKS GROUP LTD               | 151        | 183     | 4,175  | 24,343    |          | 食品・生活必需品小売り             |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD    | 226        | —       | —      | —         |          | 専門小売り                   |
| DISCOVERY LTD                  | 258        | 258     | 2,521  | 14,698    |          | 保険                      |
| GOLD FIELDS LTD                | 587        | 517     | 7,870  | 45,883    |          | 金属・鉱業                   |
| REMGRO LTD                     | 332        | 332     | 4,756  | 27,730    |          | 各種金融サービス                |
| THE FOSCHINI GROUP LTD         | 139        | 139     | 995    | 5,804     |          | 専門小売り                   |
| NORTHAM PLATINUM LTD           | —          | 179     | 1,580  | 9,214     |          | 金属・鉱業                   |
| EXXARO RESOURCES LTD           | 183        | 150     | 1,689  | 9,851     |          | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD      | 25         | 31      | 2,749  | 16,031    |          | 銀行                      |
| LIBERTY HOLDINGS LTD           | 63         | 63      | 416    | 2,425     |          | 保険                      |
| MTN GROUP LTD                  | 1,083      | 1,097   | 5,430  | 31,657    |          | 無線通信サービス                |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD          | 264        | 264     | 12,873 | 75,053    |          | 金属・鉱業                   |
| TELKOM SA SOC LTD              | 159        | 159     | 289    | 1,686     |          | 各種電気通信サービス              |
| FIRSTSTRAND LTD                | 2,116      | 2,163   | 8,781  | 51,197    |          | 各種金融サービス                |
| PSG GROUP LTD                  | 86         | 86      | 1,377  | 8,029     |          | 各種金融サービス                |
| NASPERS LTD-N SHS              | 275        | 287     | 85,645 | 499,311   |          | インターネット販売・通信販売          |
| NEDBANK GROUP LTD              | 248        | 213     | 2,072  | 12,080    |          | 銀行                      |
| NETCARE LTD                    | 728        | —       | —      | —         |          | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PICKN PAY STORES LTD           | 267        | 267     | 1,581  | 9,218     |          | 食品・生活必需品小売り             |
| RMB HOLDINGS LTD               | 436        | 548     | 2,945  | 17,172    |          | 各種金融サービス                |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD    | 29         | 29      | 2,910  | 16,968    |          | 金属・鉱業                   |
| SAPPI LIMITED                  | 320        | —       | —      | —         |          | 紙製品・林産品                 |
| SASOL LTD                      | 352        | 362     | 3,000  | 17,493    |          | 化学                      |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD          | 292        | 292     | 3,197  | 18,639    |          | 食品・生活必需品小売り             |
| STANDARD BANK GROUP LTD        | 815        | 881     | 8,659  | 50,484    |          | 銀行                      |
| SPAR GROUP LIMITED/THE         | 108        | 153     | 2,835  | 16,533    |          | 食品・生活必需品小売り             |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD        | 616        | 616     | 1,805  | 10,527    |          | 複合小売り                   |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT   | 216        | 216     | 2,805  | 16,355    |          | 医薬品                     |
| TIGER BRANDS LTD               | 87         | 128     | 2,458  | 14,333    |          | 食品                      |
| SANLAM LIMITED                 | 1,087      | 1,193   | 7,092  | 41,348    |          | 保険                      |
| INVESTEC LTD                   | 156        | 156     | 566    | 3,303     |          | 資本市場                    |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD   | —          | 458     | 4,961  | 28,925    |          | 金属・鉱業                   |
| KUMBA IRON ORE LTD             | 51         | 39      | 1,416  | 8,261     |          | 金属・鉱業                   |
| MONDI LTD                      | 72         | —       | —      | —         |          | 紙製品・林産品                 |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN   | 692        | 1,020   | 1,819  | 10,608    |          | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MMI HOLDINGS LTD               | 564        | —       | —      | —         |          | 保険                      |
| VODACOM GROUP                  | 398        | 398     | 4,913  | 28,646    |          | 無線通信サービス                |
| NEPI ROCKCASTLE PLC            | 252        | 252     | 2,111  | 12,308    |          | 不動産管理・開発                |

| 銘柄                                    | 株数      | 株数        | 期末        |         | 業種等            |  |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------|---------|----------------|--|
|                                       |         |           | 評価額       |         |                |  |
|                                       |         |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |                |  |
| (南アフリカ)                               | 百株      | 百株        | 千ランド      | 千円      |                |  |
| OLD MUTUAL LTD                        | 2,923   | 2,940     | 3,936     | 22,950  | 保険             |  |
| REINET INVESTMENTS SCA                | 87      | 87        | 2,670     | 15,571  | 資本市場           |  |
| ABSA GROUP LTD                        | 443     | 423       | 3,553     | 20,715  | 銀行             |  |
| PEPKOR HOLDINGS LTD                   | —       | 380       | 419       | 2,445   | 専門小売り          |  |
| MULTICHOICE GROUP LTD                 | 266     | 266       | 2,276     | 13,270  | メディア           |  |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS        | —       | 564       | 980       | 5,717   | 保険             |  |
| SIBANYE STILLWATER LTD                | —       | 1,610     | 5,747     | 33,509  | 金属・鉱業          |  |
| RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD | 403     | 403       | 1,009     | 5,883   | 保険             |  |
| MR PRICE GROUP LTD                    | 167     | 167       | 2,229     | 13,000  | 専門小売り          |  |
| BID CORP LTD                          | 219     | 228       | 5,474     | 31,917  | 食品・生活必需品小売り    |  |
| 小計                                    | 株数・金額   | 18,472    | 20,376    | 229,097 | 1,335,636      |  |
|                                       | 銘柄数<比率> | 44        | 44        | —       | <3.6%>         |  |
| (サウジアラビア)                             |         |           | 千サウジアラビヤル |         |                |  |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL          | —       | 143       | 654       | 18,678  | 化学             |  |
| JARIR MARKETING CO                    | —       | 37        | 508       | 14,510  | 専門小売り          |  |
| CO FOR COOPERATIVE INSURANCE          | —       | 27        | 177       | 5,074   | 保険             |  |
| ETIHAD ETISALAT CO                    | —       | 239       | 619       | 17,654  | 無線通信サービス       |  |
| SAUDI BRITISH BANK                    | —       | 416       | 951       | 27,145  | 銀行             |  |
| AL RAJHI BANK                         | —       | 806       | 4,344     | 123,900 | 銀行             |  |
| ARAB NATIONAL BANK                    | —       | 328       | 602       | 17,193  | 銀行             |  |
| BANK ALBILAD                          | —       | 233       | 490       | 13,994  | 銀行             |  |
| BANK AL - JAZIRA                      | —       | 341       | 379       | 10,814  | 銀行             |  |
| BANQUE SAUDI FRANSI                   | —       | 374       | 1,101     | 31,412  | 銀行             |  |
| RIYAD BANK                            | —       | 803       | 1,276     | 36,413  | 銀行             |  |
| SAMBA FINANCIAL GROUP                 | —       | 658       | 1,392     | 39,709  | 銀行             |  |
| SAUDI TELECOM CO                      | —       | 264       | 2,346     | 66,935  | 各種電気通信サービス     |  |
| SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO           | —       | 119       | 831       | 23,723  | 化学             |  |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP           | —       | 458       | 3,283     | 93,655  | 化学             |  |
| SAUDI CEMENT                          | —       | 64        | 282       | 8,049   | 建設資材           |  |
| SAUDI ELECTRICITY CO                  | —       | 582       | 902       | 25,727  | 電力             |  |
| SAUDI IND INVESTMENT GROUP            | —       | 187       | 338       | 9,663   | 化学             |  |
| SAVOLA                                | —       | 166       | 644       | 18,369  | 食品             |  |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION C          | —       | 100       | 93        | 2,660   | 化学             |  |
| ALMARAI CO                            | —       | 180       | 833       | 23,768  | 食品             |  |
| EMAAR ECONOMIC CITY                   | —       | 120       | 80        | 2,299   | 不動産管理・開発       |  |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCH          | —       | 293       | 401       | 11,448  | 化学             |  |
| ADVANCED PETROCHEMICALS CO            | —       | 90        | 394       | 11,254  | 化学             |  |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO          | —       | 470       | 378       | 10,790  | 化学             |  |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV          | —       | 230       | 164       | 4,683   | 不動産管理・開発       |  |
| RABIGH REFINING AND PETROCHE          | —       | 96        | 126       | 3,603   | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE           | —       | 8         | 80        | 2,299   | 保険             |  |
| ALINMA BANK                           | —       | 610       | 897       | 25,601  | 銀行             |  |
| SAUDI ARABIAN MINING CO               | —       | 282       | 955       | 27,264  | 金属・鉱業          |  |
| SAUDI AIRLINES CATERING CO            | —       | 12        | 87        | 2,498   | ホテル・レストラン・レジャー |  |
| SAUDI ARABIAN OIL CO                  | —       | 748       | 2,330     | 66,452  | 石油・ガス・消耗燃料     |  |
| NATIONAL COMMERCIAL BANK              | —       | 727       | 2,464     | 70,288  | 銀行             |  |
| 小計                                    | 株数・金額   | —         | 10,212    | 30,418  | 867,541        |  |
|                                       | 銘柄数<比率> | —         | 33        | —       | <2.3%>         |  |
| 合計                                    | 株数・金額   | 1,344,237 | 1,449,628 | —       | 33,552,644     |  |
|                                       | 銘柄数<比率> | 895       | 937       | —       | <90.8%>        |  |

\* 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により邦貨換算したものです。

\* 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国新株予約権証券

2020年5月11日現在の組入れはございません。

| 銘                                  | 柄     | 期首(前期末) |       |
|------------------------------------|-------|---------|-------|
|                                    |       | 証       | 券 数   |
| (タイ)                               |       |         | 証券    |
| MINOR INTERNATIONAL PCL (NVDR) WRT |       |         | 8,150 |
| 合 計                                | 証 券 数 | 銘 柄 数   | 8,150 |
|                                    |       |         | 1     |

## 外国投資信託証券

| 銘  | 柄             | 期首(前期末)   |           | 当 期 末   |           |     |
|--|---------------|-----------|-----------|---------|-----------|-----|
|  |               | 口 数       | 口 数       | 評 価 額   |           | 比 率 |
|  |               |           |           | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |     |
| (アメリカ)                                   |               | 口         | 口         | 千米ドル    | 千円        | %   |
| XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF |               | 96,000    | 512,300   | 14,344  | 1,534,133 | 4.1 |
| 小 計                                      | 口 数 ・ 金 額     | 96,000    | 512,300   | 14,344  | 1,534,133 |     |
|  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1         | 1         | —       | <4.1%>    |     |
| (メキシコ)                                   |               |           |           | 千メキシコペソ |           |     |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA              |               | 208,100   | 208,100   | 3,991   | 18,080    | 0.0 |
| 小 計                                      | 口 数 ・ 金 額     | 208,100   | 208,100   | 3,991   | 18,080    |     |
|  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1         | 1         | —       | <0.0%>    |     |
| (南アフリカ)                                  |               |           |           | 千ランド    |           |     |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD               |               | 191,000   | 191,000   | 2,609   | 15,210    | 0.0 |
| FORTRESS REIT LTD-A                      |               | 59,650    | 100,000   | 1,030   | 6,004     | 0.0 |
| FORTRESS REIT LTD-B                      |               | 43,946    | —         | —       | —         | —   |
| REDEFINE PROPERTIES LTD                  |               | 387,000   | 328,000   | 633     | 3,690     | 0.0 |
| HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS               |               | 13,650    | —         | —       | —         | —   |
| RESILIENT REIT LTD                       |               | 15,092    | —         | —       | —         | —   |
| 小 計                                      | 口 数 ・ 金 額     | 710,338   | 619,000   | 4,272   | 24,906    |     |
|  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 6         | 3         | —       | <0.1%>    |     |
| 合 計                                      | 口 数 ・ 金 額     | 1,014,438 | 1,339,400 | —       | 1,577,120 |     |
|  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8         | 5         | —       | <4.3%>    |     |

\*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により邦貨換算したものです。

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別    |        |       | 当 期        |          |
|--------|--------|-------|------------|----------|
|        |        |       | 買 建 額      | 売 建 額    |
| 外<br>国 | 株式先物取引 | CHA50 | 百万円<br>158 | 百万円<br>— |
|        |        | MSCIN | 1,635      | —        |
|        |        |       |            |          |

\*単位未満は切り捨て。

\*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により邦貨換算したものです。

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

| 項 目          | 当 期        |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 株式           | 33,552,644 | 90.6  |
| 投資信託受益証券     | 1,534,133  | 4.1   |
| 投資証券         | 42,987     | 0.1   |
| コール・ローン等、その他 | 1,924,017  | 5.2   |
| 投資信託財産総額     | 37,053,781 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産（36,874,224千円）の投資信託財産総額（37,053,781千円）に対する比率は99.5%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=29.25円、1米ドル=106.95円、1英ポンド=132.85円、1トルコリラ=15.09円、1ユーロ=116.00円、1チェココルナ=4.26円、1フォロント=0.3319円、1ズロチ=25.50円、1香港ドル=13.80円、1リンギ=24.68円、1パーツ=3.33円、1フィリピンペソ=2.12円、1ルビア=0.0071円、1ウォン=0.0878円、1新台湾ドル=3.58円、1インドルピー=1.42円、1パキスタンルピー=0.68円、1メキシコペソ=4.53円、1レアル=18.66円、1チリペソ=0.1293円、1コロンビアペソ=0.0275円、1UAEディルハム=29.07円、1エジプトポンド=6.79円、1ランド=5.83円、1サウジアラビアリヤル=28.52円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月11日現在)

| 項目              | 当期末             | 円 |
|-----------------|-----------------|---|
| (A) 資産          | 37,135,694,139  |   |
| コール・ローン等        | 1,220,669,225   |   |
| 株式(評価額)         | 33,552,644,565  |   |
| 投資信託受益証券(評価額)   | 1,534,133,580   |   |
| 投資証券(評価額)       | 42,987,194      |   |
| 未収入金            | 263,426,192     |   |
| 未収配当金           | 38,831,517      |   |
| 差入委託証拠金         | 483,001,866     |   |
| (B) 負債          | 166,395,364     |   |
| 未払金             | 104,296,907     |   |
| 未払解約金           | 59,845,244      |   |
| 未払利息            | 113             |   |
| その他未払費用         | 2,253,100       |   |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 36,969,298,775  |   |
| 元本              | 34,347,374,593  |   |
| 次期繰越損益金         | 2,621,924,182   |   |
| (D) 受益権総口数      | 34,347,374,593口 |   |
| 1万円当たり基準価額(C/D) | 10,763円         |   |

(注) 期首元本額は30,085,567,075円、期中追加設定元本額は7,654,679,009円、期中一部解約元本額は3,392,871,491円、1口当たり純資産額は1.0763円です。

## ○損益の状況 (2019年5月11日～2020年5月11日)

| 項目                 | 当期             | 円 |
|--------------------|----------------|---|
| (A) 配当等収益          | 932,483,243    |   |
| 受取配当金              | 925,469,452    |   |
| 受取利息               | 4,606,933      |   |
| その他収益金             | 2,448,380      |   |
| 支払利息               | △ 41,522       |   |
| (B) 有価証券売買損益       | △5,350,451,700 |   |
| 売買益                | 3,068,446,541  |   |
| 売買損                | △8,418,898,241 |   |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 116,735,711  |   |
| 取引益                | 447,665,428    |   |
| 取引損                | △ 564,401,139  |   |
| (D) 保管費用等          | △ 34,682,709   |   |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △4,569,386,877 |   |
| (F) 前期繰越損益金        | 6,572,529,124  |   |
| (G) 追加信託差損益金       | 1,321,634,354  |   |
| (H) 解約差損益金         | △ 702,852,419  |   |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 2,621,924,182  |   |
| 次期繰越損益金(I)         | 2,621,924,182  |   |

\* 損益の状況の中で(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えによるものを含みます。

\* 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、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をいいます。

\* 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名  | 当期末            | 円 |
|--|----------------|---|
|  | 元本額            |   |
| 野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)                        | 23,985,943,961 |   |
| 野村インデックスファンド・新興国株式                                 | 3,620,919,278  |   |
| ノムラPOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)                | 1,773,445,898  |   |
| 野村つみたて外国株投信  | 1,665,138,817  |   |
| 野村外国株(含む新興国)インデックスBコース(野村投資一任口座向け)                 | 1,267,432,363  |   |
| 野村外国株(含む新興国)インデックスAコース(野村投資一任口座向け)                 | 570,355,915    |   |
| NI RNIS 新興国株式・NIエマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場型 | 507,184,342    |   |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                             | 309,318,816    |   |
| 世界6資産分散ファンド  | 171,470,390    |   |
| 野村資産設計ファンド2040                                     | 108,723,740    |   |
| 野村資産設計ファンド2030                                     | 68,486,695     |   |
| 野村資産設計ファンド2025                                     | 55,673,165     |   |
| 野村資産設計ファンド2035                                     | 51,953,314     |   |
| 野村資産設計ファンド2020                                     | 33,971,178     |   |
| 野村資産設計ファンド2015                                     | 30,191,748     |   |
| 野村資産設計ファンド2050                                     | 26,833,777     |   |
| 野村資産設計ファンド2045                                     | 16,349,855     |   |

| ファンド名  | 当期末        | 円 |
|--|------------|---|
|  | 元本額        |   |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)                 | 12,129,234 |   |
| インデックス・ブレンド(タイプV)                              | 11,115,201 |   |
| インデックス・ブレンド(タイプIII)                            | 9,804,832  |   |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 9,251,374  |   |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型               | 9,130,212  |   |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNI S A) 2030                 | 5,414,216  |   |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNI S A) 2040                 | 4,280,749  |   |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型               | 4,161,964  |   |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNI S A) 2050                 | 4,102,754  |   |
| インデックス・ブレンド(タイプIV)                             | 3,375,878  |   |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型               | 3,285,576  |   |
| インデックス・ブレンド(タイプII)                             | 2,061,061  |   |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型               | 2,024,772  |   |
| インデックス・ブレンド(タイプI)                              | 1,960,058  |   |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNI S A) 2060                 | 1,783,879  |   |
| 野村POFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 99,581     |   |

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# インベスコ QQQ 信託シリーズ1

2020年9月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|             |  |
|-------------|--|
| 主 要 投 資 対 象 | 外国の株式を主要投資対象とします。  |
| 運 用 方 針     | 主として外国の株式に投資することにより、NASDAQ-100 指数(ドルベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果を目指します。 |
| 投 資 顧 問 会 社 | インベスコ・キャピタル・マネジメント・エル・エル・シー  |
| 受 託 会 社     | ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン  |

\*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

## 損益計算書

2020年9月30日に終了する計測期間

|                         | 米ドル             |
|-------------------------|-----------------|
| <b>投資収益</b>             |                 |
| 受取配当                    | 947,785,717     |
| 外国源泉税                   | (949,316)       |
| 投資収益合計                  | 946,836,401     |
| <b>費用</b>               |                 |
| ライセンス料                  | 82,322,671      |
| 専門家報酬                   | 146,752         |
| マーケティング費用               | 66,859,915      |
| 受託者報酬                   | 48,015,660      |
| その他費用                   | 2,095,530       |
| 費用合計                    | 199,440,528     |
| 純投資収益                   | 747,395,873     |
| <b>実現および未実現(損)益</b>     |                 |
| <b>実現純(損)益</b>          |                 |
| 投資有価証券                  | (1,113,632,290) |
| 現物償還                    | 30,481,333,772  |
| <b>実現純利益</b>            | 29,367,701,482  |
| 投資有価証券に係る未実現純評価(損)益の変動額 | 11,445,165,757  |
| <b>実現および未実現純評価益</b>     | 40,812,867,239  |
| 運用による純資産の純変動額           | 41,560,263,112  |

投資有価証券明細表<sup>(a)</sup>  
(2020年9月30日現在)

|   | 株数         | 市場価格<br>(米ドル) |
|---|------------|---------------|
| <b>普通株式およびその他の資本持分-99.98%</b>                               |            |               |
| <b>自動車-3.45%</b>  |            |               |
| Tesla, Inc. <sup>(b)</sup>                                  | 10,926,558 | 4,687,602,648 |
| <b>飲料-2.02%</b>   |            |               |
| Monster Beverage Corp. <sup>(b)</sup>                       | 6,184,415  | 495,990,083   |
| PepsiCo, Inc.   | 16,236,345 | 2,250,357,417 |
|   |            | 2,746,347,500 |
| <b>バイオテクノロジー-4.52%</b>                                      |            |               |
| Alexion Pharmaceuticals, Inc. <sup>(b)</sup>                | 2,569,759  | 294,057,522   |
| Amgen, Inc.   | 6,868,026  | 1,745,577,488 |
| Biogen, Inc. <sup>(b)</sup>                                 | 1,856,132  | 526,547,526   |
| BioMarin Pharmaceutical, Inc. <sup>(b)</sup>                | 2,126,649  | 161,795,456   |
| Gilead Sciences, Inc.                                       | 14,701,296 | 928,974,894   |
| Incyte Corp. <sup>(b)</sup>                                 | 2,564,678  | 230,154,204   |
| Moderna, Inc. <sup>(b)</sup>                                | 4,626,852  | 327,349,779   |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. <sup>(b)</sup>              | 1,226,083  | 686,336,742   |
| Seattle Genetics, Inc. <sup>(b)</sup>                       | 2,040,362  | 399,278,440   |
| Vertex Pharmaceuticals, Inc. <sup>(b)</sup>                 | 3,054,145  | 831,093,937   |
|   |            | 6,131,165,988 |
| <b>商業サービス・用品-0.51%</b>                                      |            |               |
| Cintas Corp.  | 1,213,294  | 403,820,642   |
| Copart, Inc. <sup>(b)</sup>                                 | 2,752,842  | 289,488,865   |
|   |            | 693,309,507   |
| <b>通信機器-1.44%</b>   |            |               |
| Cisco Systems, Inc.   | 49,510,807 | 1,950,230,688 |
| <b>総合通信サービス-0.10%</b>                                       |            |               |
| Liberty Global PLC, Class A (United Kingdom) <sup>(b)</sup> | 2,137,423  | 44,907,257    |
| Liberty Global PLC, Class C (United Kingdom) <sup>(b)</sup> | 4,676,361  | 96,029,073    |
|   |            | 140,936,330   |
| <b>電力-0.62%</b>   |            |               |
| Exelon Corp.  | 11,427,115 | 408,633,633   |
| Xcel Energy, Inc.   | 6,160,126  | 425,110,295   |
|   |            | 833,743,928   |
| <b>電子装置・機器および構成部品-0.15%</b>                                 |            |               |
| CDW Corp.   | 1,672,607  | 199,926,715   |
| <b>娯楽-3.22%</b>   |            |               |
| Activision Blizzard, Inc.                                   | 9,051,063  | 732,683,550   |

|  | 株数         | 市場価格<br>(米ドル)         |
|--|------------|-----------------------|
| Electronic Arts, Inc. <sup>(b)</sup>               | 3,386,339  | 441,612,469           |
| NetEase, Inc., ADR (China)                         | 841,046    | 382,398,385           |
| Netflix, Inc. <sup>(b)</sup>                       | 5,171,382  | 2,585,846,141         |
| Take-Two Interactive Software, Inc. <sup>(b)</sup> | 1,340,399  | 221,460,723           |
|  |            | <u>4,364,001,268</u>  |
| <b>食品・生活必需品小売り-1.62%</b>                           |            |                       |
| Costco Wholesale Corp.                             | 5,177,750  | 1,838,101,250         |
| Walgreens Boots Alliance, Inc.                     | 10,160,976 | 364,982,258           |
|  |            | <u>2,203,083,508</u>  |
| <b>食品-1.03%</b>                                    |            |                       |
| Kraft Heinz Co. (The)                              | 14,335,975 | 429,362,451           |
| Mondelez International, Inc., Class A              | 16,748,875 | 962,222,869           |
|  |            | <u>1,391,585,320</u>  |
| <b>ヘルスケア機器・用品-1.57%</b>                            |            |                       |
| Align Technology, Inc. <sup>(b)</sup>              | 924,025    | 302,488,824           |
| DexCom, Inc. <sup>(b)</sup>                        | 1,122,715  | 462,816,805           |
| IDEXX Laboratories, Inc. <sup>(b)</sup>            | 997,327    | 392,059,217           |
| Intuitive Surgical, Inc. <sup>(b)</sup>            | 1,372,460  | 973,815,268           |
|  |            | <u>2,131,180,114</u>  |
| <b>ヘルスケア・テクノロジー-0.19%</b>                          |            |                       |
| Cerner Corp.                                       | 3,580,848  | 258,859,502           |
| <b>ホテル・レストラン・レジャー-1.13%</b>                        |            |                       |
| Marriott International, Inc., Class A              | 3,803,229  | 352,102,941           |
| Starbucks Corp.                                    | 13,708,004 | 1,177,791,703         |
|  |            | <u>1,529,894,644</u>  |
| <b>インタラクティブ・メディア・サービス-11.32%</b>                   |            |                       |
| Alphabet, Inc., Class A <sup>(b)</sup>             | 3,169,332  | 4,644,972,979         |
| Alphabet, Inc., Class C <sup>(b)</sup>             | 3,066,684  | 4,506,798,807         |
| Baidu, Inc., ADR (China) <sup>(b)</sup>            | 3,297,465  | 417,426,094           |
| Facebook, Inc., Class A <sup>(b)</sup>             | 22,101,519 | 5,788,387,826         |
|  |            | <u>15,357,585,706</u> |
| <b>インターネット販売・カタログ販売-13.12%</b>                     |            |                       |
| Amazon.com, Inc. <sup>(b)</sup>                    | 4,604,448  | 14,498,163,551        |
| Booking Holdings, Inc. <sup>(b)</sup>              | 480,112    | 821,317,996           |
| eBay, Inc.   | 8,206,717  | 427,569,956           |
| Expedia Group, Inc.                                | 1,591,316  | 145,907,764           |
| JD.com, Inc., ADR (China) <sup>(b)</sup>           | 10,762,946 | 835,312,239           |
| MercadoLibre, Inc. (Argentina) <sup>(b)</sup>      | 583,030    | 631,118,315           |
| Pinduoduo, Inc., ADR (China) <sup>(b)</sup>        | 3,383,540  | 250,889,491           |
| Trip.com Group Ltd., ADR (China) <sup>(b)</sup>    | 6,132,044  | 190,951,850           |
|  |            | <u>17,801,231,162</u> |

| 株数 | 市場価格<br>(米ドル) |
|----|---------------|
|----|---------------|

**ITサービス-3.89%**

|   |            |                      |
|---|------------|----------------------|
| Automatic Data Processing, Inc.               | 5,041,907  | 703,295,607          |
| Cognizant Technology Solutions Corp., Class A | 6,358,550  | 441,410,541          |
| Fiserv, Inc. <sup>(b)</sup>                   | 7,852,591  | 809,209,502          |
| Paychex, Inc.                                 | 4,206,853  | 335,580,664          |
| PayPal Holdings, Inc. <sup>(b)</sup>          | 13,758,363 | 2,710,810,262        |
| VeriSign, Inc. <sup>(b)</sup>                 | 1,346,841  | 275,900,379          |
|   |            | <u>5,276,206,955</u> |

**ライフサイエンス・ツール・サービス-0.39%**

|                               |           |                    |
|-------------------------------|-----------|--------------------|
| Illumina, Inc. <sup>(b)</sup> | 1,711,660 | <u>529,039,873</u> |
|-------------------------------|-----------|--------------------|

**機械-0.26%**

|              |           |                    |
|--------------|-----------|--------------------|
| PACCAR, Inc. | 4,058,916 | <u>346,144,356</u> |
|--------------|-----------|--------------------|

**メディア-3.27%**

|  |            |                      |
|--|------------|----------------------|
| Charter Communications, Inc., Class A <sup>(b)</sup> | 2,402,433  | 1,499,935,019        |
| Comcast Corp., Class A                               | 53,455,376 | 2,472,845,694        |
| Fox Corp., Class A                                   | 4,029,940  | 112,153,230          |
| Fox Corp., Class B                                   | 3,061,672  | 85,634,966           |
| Sirius XM Holdings, Inc.                             | 50,894,553 | 272,794,804          |
|  |            | <u>4,443,363,713</u> |

**複合小売り-0.19%**

|                                  |           |                    |
|----------------------------------|-----------|--------------------|
| Dollar Tree, Inc. <sup>(b)</sup> | 2,782,497 | <u>254,153,276</u> |
|----------------------------------|-----------|--------------------|

**専門サービス-0.26%**

|                        |           |                    |
|------------------------|-----------|--------------------|
| Verisk Analytics, Inc. | 1,904,189 | <u>352,865,264</u> |
|------------------------|-----------|--------------------|

**陸運・鉄道-0.51%**

|           |           |                    |
|-----------|-----------|--------------------|
| CSX Corp. | 8,970,919 | <u>696,771,279</u> |
|-----------|-----------|--------------------|

**半導体・半導体装置-12.48%**

|  |            |                       |
|--|------------|-----------------------|
| Advanced Micro Devices, Inc. <sup>(b)</sup>      | 13,767,274 | 1,128,778,795         |
| Analog Devices, Inc.                             | 4,329,222  | 505,393,376           |
| Applied Materials, Inc.                          | 10,709,361 | 636,671,512           |
| ASML Holding N.V., New York Shares (Netherlands) | 895,266    | 330,594,876           |
| Broadcom, Inc.                                   | 4,687,868  | 1,707,884,070         |
| Intel Corp.                                      | 49,870,899 | 2,582,315,150         |
| KLA Corp.  | 1,823,110  | 353,209,331           |
| Lam Research Corp.                               | 1,707,696  | 566,528,148           |
| Maxim Integrated Products, Inc.                  | 3,127,202  | 211,430,127           |
| Microchip Technology, Inc.                       | 2,960,008  | 304,170,422           |
| Micron Technology, Inc. <sup>(b)</sup>           | 13,027,728 | 611,782,107           |
| NVIDIA Corp.                                     | 7,234,869  | 3,915,655,800         |
| NXP Semiconductors N.V. (Netherlands)            | 3,274,535  | 408,694,713           |
| QUALCOMM, Inc.                                   | 13,230,311 | 1,556,942,999         |
| Skyworks Solutions, Inc.                         | 1,958,875  | 285,016,313           |
| Texas Instruments, Inc.                          | 10,740,541 | 1,533,641,849         |
| Xilinx, Inc.                                     | 2,865,137  | 298,661,881           |
|  |            | <u>16,937,371,469</u> |

| 株数 | 市場価格<br>(米ドル) |
|----|---------------|
|----|---------------|

**ソフトウェア-16.73%**

|  |            |                       |
|--|------------|-----------------------|
| Adobe, Inc. <sup>(b)</sup>                                     | 5,624,526  | 2,758,436,286         |
| ANSYS, Inc. <sup>(b)</sup>                                     | 1,005,985  | 329,188,471           |
| Autodesk, Inc. <sup>(b)</sup>                                  | 2,569,878  | 593,667,517           |
| Cadence Design Systems, Inc. <sup>(b)</sup>                    | 3,269,047  | 348,578,482           |
| Check Point Software Technologies Ltd. (Israel) <sup>(b)</sup> | 1,643,715  | 197,804,663           |
| Citrix Systems, Inc.   | 1,448,186  | 199,429,694           |
| DocuSign, Inc. <sup>(b)</sup>                                  | 2,169,273  | 466,914,320           |
| Intuit, Inc.   | 3,070,265  | 1,001,551,146         |
| Microsoft Corp.  | 69,565,441 | 14,631,699,205        |
| Splunk, Inc. <sup>(b)</sup>                                    | 1,862,684  | 350,426,741           |
| Synopsys, Inc. <sup>(b)</sup>                                  | 1,779,254  | 380,724,771           |
| Workday, Inc., Class A <sup>(b)</sup>                          | 2,075,729  | 446,551,580           |
| Zoom Video Communications, Inc., Class A <sup>(b)</sup>        | 2,135,552  | 1,003,944,351         |
|  |            | <u>22,708,917,227</u> |

**専門小売り-0.69%**

|  |           |                    |
|--|-----------|--------------------|
| O'Reilly Automotive, Inc. <sup>(b)</sup> | 868,530   | 400,461,812        |
| Ross Stores, Inc.                        | 4,173,875 | 389,506,015        |
| Ulta Beauty, Inc. <sup>(b)</sup>         | 660,600   | 147,961,188        |
|  |           | <u>937,929,015</u> |

**テクノロジー・ハードウェア・記憶装置・周辺機器-13.51%**

|                       |             |                       |
|-----------------------|-------------|-----------------------|
| Apple, Inc.           | 157,215,671 | 18,207,146,858        |
| Western Digital Corp. | 3,547,783   | 129,671,469           |
|                       |             | <u>18,336,818,327</u> |

**繊維・アパレル・贅沢品-0.35%**

|  |           |             |
|--|-----------|-------------|
| lululemon athletica, inc. <sup>(b)</sup> | 1,457,395 | 480,022,191 |
|--|-----------|-------------|

**商社・流通業-0.22%**

|              |           |             |
|--------------|-----------|-------------|
| Fastenal Co. | 6,726,146 | 303,281,923 |
|--------------|-----------|-------------|

**無線通信サービス-1.22%**

|                                  |            |               |
|----------------------------------|------------|---------------|
| T-Mobile US, Inc. <sup>(b)</sup> | 14,514,709 | 1,659,902,121 |
|----------------------------------|------------|---------------|

投資有価証券合計-99.98%  
(取得原価 \$129,114,153,470)

135,683,471,517

その他資産(負債控除後) -0.02%

30,728,391

純資産-100.00%

135,714,199,908

略語:

ADR - 米国預託証券

投資明細表に対する注記:

(a) この報告書で使用されている産業およびセクター分類は、概ね世界産業分類基準に従っている。世界産業分類基準はMSCIインクとスタンダード・アンド・プアーズによって開発され、その独占的所有物でありサービス・マークである。

(b) インカムを生まない有価証券