

## 運用報告書 (全体版)

第12期<決算日2020年5月8日>

### MHAM外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)

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/海外/株式/インデックス型  |  |
| 信託期間   | 2008年6月3日から無期限です。  |  |
| 運用方針   | MSCIコクサイ・インデックス (円ベース・為替ヘッジなし)*の動きに連動する投資成果を目指します。<br>※税引き前配当再投資ベースとします (以下同じ)。  |  |
| 主要投資対象 | MHAM外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)   | MHAM外国株式インデックスマザーファンド 受益証券を主要投資対象とします。             |
|        | MHAM外国株式インデックスマザーファンド  | MSCIコクサイ・インデックスを構成している国 (地域を含みます。) の株式を主要投資対象とします。 |
| 運用方法   | 株式への投資割合は、原則として高位を維持します。運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入時価総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |  |
| 組入制限   | MHAM外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)   | 株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。      |
|        | MHAM外国株式インデックスマザーファンド  | 株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。          |
| 分配方針   | 毎期原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。                    |  |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAM外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)」は、2020年5月8日に第12期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

# MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）

## ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額        |               |               | MSCIコクサイ・インデックス<br>(円ベース・為替ヘッジなし) |               | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額     |
|----------------|-------------|---------------|---------------|-----------------------------------|---------------|------------|------------|-------------------------------|---------------|
|                | (分配落)       | 税込<br>分配<br>金 | 期中<br>騰落<br>率 | (ベンチマーク)                          | 期中<br>騰落<br>率 |            |            |                               |               |
| 8期(2016年5月9日)  | 円<br>12,928 | 円<br>0        | %<br>△15.2    | 円<br>2,221.98                     | %<br>△14.7    | %<br>95.5  | %<br>1.6   | %<br>2.7                      | 百万円<br>36,064 |
| 9期(2017年5月8日)  | 15,992      | 0             | 23.7          | 2,785.42                          | 25.4          | 94.6       | 2.8        | 2.5                           | 22,752        |
| 10期(2018年5月8日) | 17,280      | 0             | 8.1           | 3,046.31                          | 9.4           | 94.5       | 3.2        | 2.3                           | 17,901        |
| 11期(2019年5月8日) | 18,307      | 0             | 5.9           | 3,249.57                          | 6.7           | 92.5       | 5.0        | 2.5                           | 19,164        |
| 12期(2020年5月8日) | 17,099      | 0             | △6.6          | 3,054.30                          | △6.0          | 93.2       | 4.2        | 2.4                           | 21,926        |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) MSCIコクサイ・インデックス（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前営業日（現地ベース）の値を用いております（小数第3位四捨五入）（以下同じ）。

(注4) MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCI Inc. が開発した指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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（以下同じ）。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日               | 基準価額        |          | MSCIコクサイ・インデックス<br>(円ベース・為替ヘッジなし) |        | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 |
|-------------------|-------------|----------|-----------------------------------|--------|------------|------------|-------------------------------|
|                   | 騰落率         | (ベンチマーク) | 騰落率                               |        |            |            |                               |
| (期首)<br>2019年5月8日 | 円<br>18,307 | %<br>—   | 円<br>3,249.57                     | %<br>— | %<br>92.5  | %<br>5.0   | %<br>2.5                      |
| 5月末               | 17,637      | △3.7     | 3,140.70                          | △3.4   | 92.7       | 4.7        | 2.6                           |
| 6月末               | 18,268      | △0.2     | 3,240.27                          | △0.3   | 93.9       | 3.5        | 2.6                           |
| 7月末               | 18,760      | 2.5      | 3,328.93                          | 2.4    | 93.9       | 3.4        | 2.6                           |
| 8月末               | 17,819      | △2.7     | 3,165.56                          | △2.6   | 93.5       | 3.7        | 2.8                           |
| 9月末               | 18,387      | 0.4      | 3,275.15                          | 0.8    | 93.0       | 4.4        | 2.7                           |
| 10月末              | 19,110      | 4.4      | 3,394.32                          | 4.5    | 93.2       | 4.1        | 2.7                           |
| 11月末              | 19,813      | 8.2      | 3,523.71                          | 8.4    | 92.8       | 4.5        | 2.6                           |
| 12月末              | 20,403      | 11.4     | 3,631.40                          | 11.8   | 94.4       | 2.9        | 2.6                           |
| 2020年1月末          | 20,420      | 11.5     | 3,624.06                          | 11.5   | 93.9       | 3.3        | 2.7                           |
| 2月末               | 18,808      | 2.7      | 3,369.37                          | 3.7    | 93.8       | 1.7        | 2.7                           |
| 3月末               | 15,969      | △12.8    | 2,833.70                          | △12.8  | 90.1       | 7.4        | 2.5                           |
| 4月末               | 17,527      | △4.3     | 3,121.08                          | △4.0   | 93.2       | 4.3        | 2.5                           |
| (期末)<br>2020年5月8日 | 17,099      | △6.6     | 3,054.30                          | △6.0   | 93.2       | 4.2        | 2.4                           |

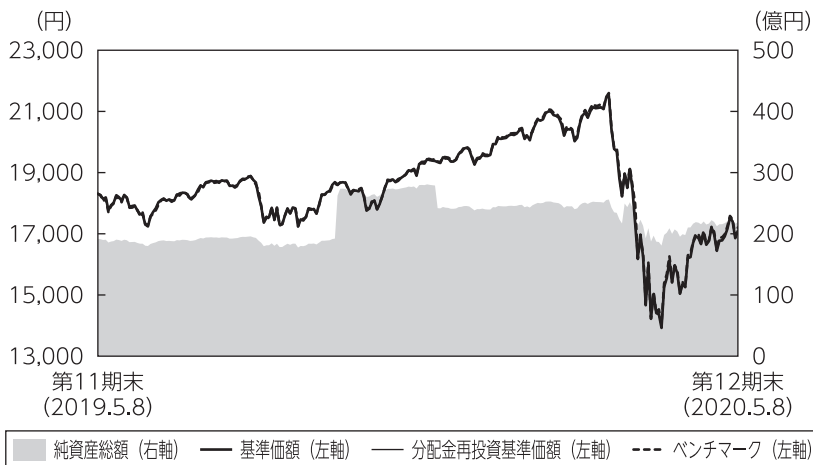
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

### 基準価額等の推移



第12期首：18,307円  
第12期末：17,099円  
(既払分配金0円)  
騰落率：△6.6%  
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク (MSCIコクサイ・インデックス (円ベース・為替ヘッジなし)) は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

MHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、海外の先進国株式への投資を行った結果、海外の先進国株式市況が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

## 投資環境

### ●海外株式市況と為替市場

先進国株式市場は米国による対中追加関税に対する不透明感などから上値の重い展開となりましたが、10月中旬以降は米中通商協議の進展期待から上昇傾向となりました。2020年も米中通商協議の第一段階の合意署名を受け上昇しましたが、2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され大きく下落しました。3月下旬以降は反発しましたが、前期末と比べて下落して期末を迎えました。

為替市場では、米ドルは米中通商協議を巡る混乱からドル安円高が進行したものの、2019年8月に対中追加関税の一部発動延期等をきっかけとしてドル高円安基調となりました。2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され為替は乱高下し、期末時点では前期末と比べてドル安円高となりました。ユーロも円に対して弱含み前期末比で円高となりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

MHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

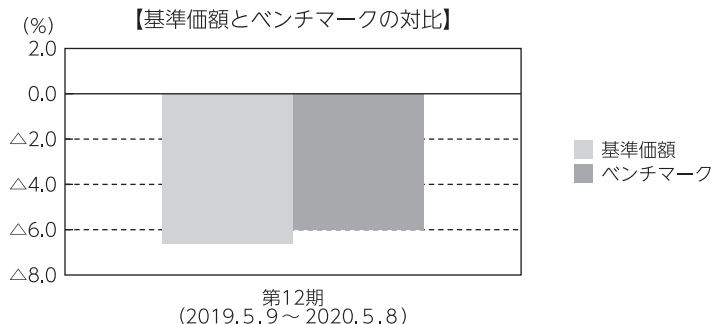
### ●MHAM外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末に比べて6.0%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.6%程度下回りました。この差異は、主に信託報酬やマザーファンドで保有する株式の配当に対する課税などのマイナス要因によるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目         | 当期                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2019年5月9日<br>～2020年5月8日 |
| 当期分配金（税引前） | －円                      |
| 対基準価額比率    | －％                      |
| 当期の収益      | －円                      |
| 当期の収益以外    | －円                      |
| 翌期繰越分配対象額  | 9,785円                  |

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

引き続き、MHAM外国株式インデックスマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

### ●MHAM外国株式インデックスマザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 第12期                      |         | 項目の概要  |
|-------------|---------------------------|---------|--|
|             | (2019年5月9日<br>～2020年5月8日) |         |  |
|             | 金額                        | 比率      |  |
| (a) 信託報酬    | 73円                       | 0.393%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は18,494円です。                     |
| (投信会社)      | (61)                      | (0.328) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価                             |
| (販売会社)      | ( 2)                      | (0.011) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付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等の対価                     |
| (受託会社)      | (10)                      | (0.055) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価                                 |
| (b) 売買委託手数料 | 2                         | 0.009   | (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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料   |
| (株式)        | ( 1)                      | (0.007) |  |
| (先物・オプション)  | ( 0)                      | (0.002) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                      | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 0)                      | (0.000) |  |
| (c) 有価証券取引税 | 4                         | 0.023   | (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)        | ( 4)                      | (0.022) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                      | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 0)                      | (0.000) |  |
| (d) その他費用   | 17                        | 0.094   | (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)      | (11)                      | (0.060) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用   |
| (監査費用)      | ( 1)                      | (0.003) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用   |
| (その他)       | ( 6)                      | (0.030) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等   |
| 合計          | 96                        | 0.519   |  |

(注1) 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・解約によって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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

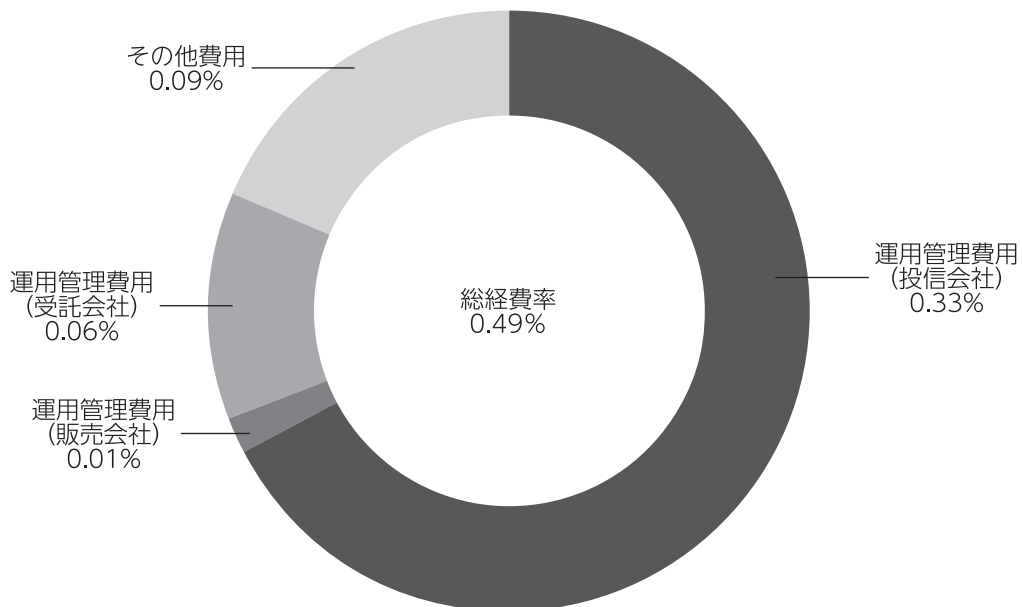
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.49%です。



(注1) 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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年5月9日から2020年5月8日まで）

|                           | 設 定             |                  | 解 約             |                 |
|---------------------------|-----------------|------------------|-----------------|-----------------|
|                           | □ 数             | 金 額              | □ 数             | 金 額             |
| MHAM外国株式インデックス<br>マザーファンド | 千□<br>5,610,924 | 千円<br>10,891,122 | 千□<br>3,402,941 | 千円<br>6,763,789 |

## ■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               | MHAM外国株式インデックスマザーファンド |
|-------------------|-----------------------|
| (a) 期中の株式売買金額     | 28,091,549千円          |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 31,956,895千円          |
| (c) 売買高比率(a)/(b)  | 0.87                  |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2019年5月9日から2020年5月8日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

親投資信託残高

|                       | 期首（前期末）          | 当 期 末            |                  |
|-----------------------|------------------|------------------|------------------|
|                       | □ 数              | □ 数              | 評 価 額            |
| MHAM外国株式インデックスマザーファンド | 千□<br>10,028,954 | 千□<br>12,236,937 | 千円<br>21,924,921 |

## ■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

| 項 目                     | 当 期 末            |           |
|-------------------------|------------------|-----------|
|                         | 評 価 額            | 比 率       |
| MHAM外国株式インデックスマザーファンド   | 千円<br>21,924,921 | %<br>99.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 74,082           | 0.3       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 21,999,003       | 100.0     |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末のMHAM外国株式インデックスマザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、29,574,742千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1香港・ドル=13.72円、1シンガポール・ドル=75.36円、1ニュージーランド・ドル=65.01円、1イギリス・ポンド=131.74円、1イスラエル・シェケル=30.31円、1スイス・フラン=109.42円、1デンマーク・クローネ=15.46円、1ノルウェー・クローネ=10.41円、1スウェーデン・クローナ=10.86円、1ユーロ=115.36円です。



## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

| 項 目                            | 当 期 末           |
|--------------------------------|-----------------|
| (A) 資 産                        | 21,999,003,883円 |
| コー ル ・ ロ ー ン 等                 | 60,140,623      |
| MHAM外国株式インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 21,924,921,260  |
| 未 収 入 金                        | 13,942,000      |
| (B) 負 債                        | 72,931,412      |
| 未 払 解 約 金                      | 26,335,470      |
| 未 払 信 託 報 酬                    | 46,203,556      |
| そ の 他 未 払 費 用                  | 392,386         |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)             | 21,926,072,471  |
| 元 本                            | 12,822,837,824  |
| 次 期 繰 越 損 益 金                  | 9,103,234,647   |
| (D) 受 益 権 総 口 数                | 12,822,837,824口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                | 17,099円         |

(注) 期首における元本額は10,468,393,628円、当期中における追加設定元本額は6,492,650,141円、同解約元本額は4,138,205,945円です。

## ■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

| 項 目                  | 当 期              |
|----------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | △40,868円         |
| 受 取 利 息              | 5,043            |
| 支 払 利 息              | △45,911          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | △1,593,565,750   |
| 売 買 損 益              | 423,377,649      |
| 売 買 損                | △2,016,943,399   |
| (C) 信 託 報 酬 等        | △88,520,541      |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △1,682,127,159   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 2,270,664,347    |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 8,514,697,459    |
| (配 当 等 相 当 額)        | (9,892,867,515)  |
| (売 買 損 益 相 当 額)      | (△1,378,170,056) |
| (G) 合 計(D+E+F)       | 9,103,234,647    |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G)     | 9,103,234,647    |
| 追 加 信 託 差 損 益 金      | 8,514,697,459    |
| (配 当 等 相 当 額)        | (9,910,624,005)  |
| (売 買 損 益 相 当 額)      | (△1,395,926,546) |
| 分 配 準 備 積 立 金        | 2,636,928,504    |
| 繰 越 損 益 金            | △2,048,391,316   |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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。

(注3) (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4) 分配金の計算過程

| 項 目                          | 当 期            |
|------------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益              | 366,264,157円   |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益          | 0              |
| (c) 収 益 調 整 金                | 9,910,624,005  |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金            | 2,270,664,347  |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)   | 12,547,552,509 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 9,785.32       |
| (g) 分 配 金                    | 0              |
| (h) 1 万 口 当 たり 分 配 金         | 0              |

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。

# MHAM外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書

第12期（決算日 2020年5月8日）

（計算期間 2019年5月9日～2020年5月8日）

MHAM外国株式インデックスマザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2008年6月3日から無期限です。  |
| 運用方針   | MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）*の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。<br>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。<br>※税引き前配当再投資ベースとします（以下同じ）。 |
| 主要投資対象 | MSCIコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。  |

### ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額   |           | MSCIコクサイ・インデックス<br>（円ベース・為替ヘッジなし）<br>（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>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|----------------|--------|-----------|---|-----------|------------|------------|-------------------------------|-----------|
|                | 円      | 期中<br>騰落率 | 円   | 期中<br>騰落率 |            |            |                               |           |
| 8期(2016年5月9日)  | 13,334 | △14.8     | 2,221.98                                      | △14.7     | 95.5       | 1.6        | 2.7                           | 40,035    |
| 9期(2017年5月8日)  | 16,560 | 24.2      | 2,785.42                                      | 25.4      | 94.6       | 2.8        | 2.5                           | 34,010    |
| 10期(2018年5月8日) | 17,964 | 8.5       | 3,046.31                                      | 9.4       | 94.5       | 3.2        | 2.3                           | 24,890    |
| 11期(2019年5月8日) | 19,107 | 6.4       | 3,249.57                                      | 6.7       | 92.5       | 5.0        | 2.5                           | 28,690    |
| 12期(2020年5月8日) | 17,917 | △6.2      | 3,054.30                                      | △6.0      | 93.2       | 4.2        | 2.4                           | 29,595    |

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）MSCIコクサイ・インデックス（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前営業日（現地ベース）の値を用いております（小数第3位四捨五入）（以下同じ）。

（注3）MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCI Inc. が開発した指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

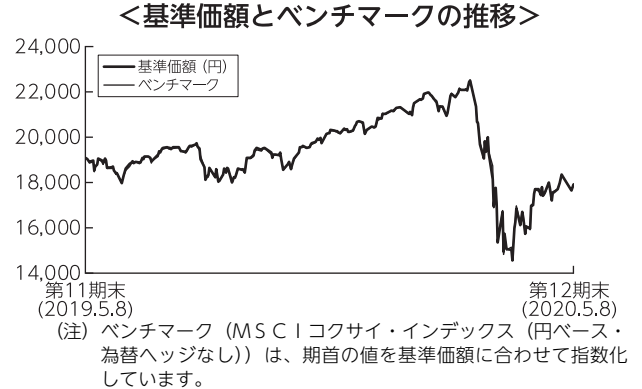
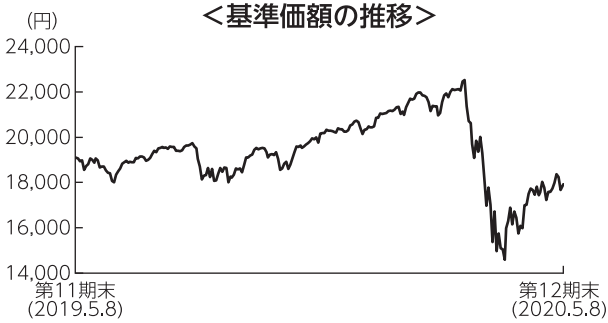
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                | 基 準 価 額 |       | MSCIコクサイ・インデックス<br>(円ベース・為替ヘッジなし) |       | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 |
|----------------------|---------|-------|-----------------------------------|-------|-------------|-------------|-------------------------------|
|                      |         | 騰 落 率 | (ベンチマーク)                          | 騰 落 率 |             |             |                               |
| (期 首)<br>2019年 5月 8日 | 円       | %     |                                   | %     | %           | %           | %                             |
|                      | 19,107  | -     | 3,249.57                          | -     | 92.5        | 5.0         | 2.5                           |
| 5月末                  | 18,412  | △3.6  | 3,140.70                          | △3.4  | 92.7        | 4.7         | 2.6                           |
| 6月末                  | 19,077  | △0.2  | 3,240.27                          | △0.3  | 93.9        | 3.5         | 2.6                           |
| 7月末                  | 19,597  | 2.6   | 3,328.93                          | 2.4   | 93.9        | 3.4         | 2.6                           |
| 8月末                  | 18,620  | △2.5  | 3,165.56                          | △2.6  | 93.5        | 3.7         | 2.8                           |
| 9月末                  | 19,220  | 0.6   | 3,275.15                          | 0.8   | 93.0        | 4.4         | 2.7                           |
| 10月末                 | 19,983  | 4.6   | 3,394.32                          | 4.5   | 93.2        | 4.1         | 2.7                           |
| 11月末                 | 20,724  | 8.5   | 3,523.71                          | 8.4   | 92.8        | 4.5         | 2.6                           |
| 12月末                 | 21,349  | 11.7  | 3,631.40                          | 11.8  | 94.4        | 2.9         | 2.6                           |
| 2020年 1月末            | 21,374  | 11.9  | 3,624.06                          | 11.5  | 93.9        | 3.3         | 2.7                           |
| 2月末                  | 19,693  | 3.1   | 3,369.37                          | 3.7   | 93.8        | 1.7         | 2.7                           |
| 3月末                  | 16,726  | △12.5 | 2,833.70                          | △12.8 | 90.1        | 7.4         | 2.5                           |
| 4月末                  | 18,364  | △3.9  | 3,121.08                          | △4.0  | 93.2        | 4.3         | 2.5                           |
| (期 末)<br>2020年 5月 8日 | 17,917  | △6.2  | 3,054.30                          | △6.0  | 93.2        | 4.2         | 2.4                           |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2019年5月9日から2020年5月8日まで）



### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は17,917円となり、前期末比で6.2%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

株式市場は2020年2月までは堅調に推移しましたが、新型コロナウイルスの影響から多くの市場が下落したことに加え、為替市場ではほとんどの通貨が対円で下落しマイナスの寄与となったことから、当ファンドの基準価額は下落しました。

### 投資環境

先進国株式市場は米国による対中追加関税に対する不透明感などから上値の重い展開となりましたが、10月中旬以降は米中通商協議の進展期待から上昇傾向となりました。2020年も米中通商協議の第一段階の合意署名を受け上昇しましたが、2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され大きく下落しました。3月下旬以降は反発しましたが、前期末と比べて下落して期末を迎えました。

為替市場では、米ドルは米中通商協議を巡る混乱からドル安円高が進行したものの、2019年8月に対中追加関税の一部発動延期等をきっかけとしてドル高円安基調となりました。2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され為替は乱高下し、期末時点では前期末と比べてドル安円高となりました。ユーロも円に対して弱含み前期末比で円高となりました。

## ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円ベース、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末に比べて6.0%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.2%程度下回りました。この差異は、主に保有株式の配当に対する課税などのマイナス要因によるものです。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 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)<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券) | 2円<br>( 1)<br>( 0)<br>( 0)<br>( 0) | 0.009%<br>(0.007)<br>(0.002)<br>(0.000)<br>(0.000) | (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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料              |
| (b) 有価証券取引税<br>(株式)<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券)               | 4<br>( 4)<br>( 0)<br>( 0)          | 0.022<br>(0.022)<br>(0.000)<br>(0.000)             | (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)                              | 18<br>(12)<br>( 6)                 | 0.093<br>(0.061)<br>(0.032)                        | (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、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計  | 24                                 | 0.124  |   |
| 期中の平均基準価額は19,339円です。                                      |                                    |  |   |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■ 売買及び取引の状況 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

### (1) 株 式

|     |          | 買 付                        |                              | 売 付            |                      |
|-----|----------|----------------------------|------------------------------|----------------|----------------------|
|     |          | 株 数                        | 金 額                          | 株 数            | 金 額                  |
| 外 国 | ア メ リ カ  | 百株<br>12,070.7<br>(61.59)  | 千アメリカ・ドル<br>99,984<br>(△866) | 百株<br>9,553.92 | 千アメリカ・ドル<br>76,048   |
|     | カ ナ ダ    | 百株<br>1,478.88<br>(△16.05) | 千カナダ・ドル<br>7,720<br>(△26)    | 百株<br>1,235.66 | 千カナダ・ドル<br>5,809     |
|     | オーストラリア  | 百株<br>3,687.7<br>(△1.58)   | 千オーストラリア・ドル<br>5,451<br>(△6) | 百株<br>2,672.79 | 千オーストラリア・ドル<br>4,013 |
|     | 香 港      | 百株<br>3,109<br>(73.45)     | 千香港・ドル<br>14,486<br>(-)      | 百株<br>2,465.85 | 千香港・ドル<br>10,967     |
|     | シンガポール   | 百株<br>1,010<br>(-)         | 千シンガポール・ドル<br>719<br>(-)     | 百株<br>1,120.29 | 千シンガポール・ドル<br>460    |
|     | ニュージーランド | 百株<br>267.5<br>(-)         | 千ニュージーランド・ドル<br>187<br>(-)   | 百株<br>117.11   | 千ニュージーランド・ドル<br>79   |

|         |             | 買 付                          |                                | 売 付                    |                        |               |
|---------|-------------|------------------------------|--------------------------------|------------------------|------------------------|---------------|
|         |             | 株 数                          | 金 額                            | 株 数                    | 金 額                    |               |
| 外<br>国  | イ ギ リ ス     | 百株<br>12,387.82<br>(△405.83) | 千イギリス・ポンド<br>7,430<br>(△18)    | 百株<br>17,119.03        | 千イギリス・ポンド<br>5,316     |               |
|         | イ ス ラ エ ル   | 百株<br>240.97<br>(5.73)       | 千イスラエル・シケル<br>656<br>(-)       | 百株<br>246.53           | 千イスラエル・シケル<br>332      |               |
|         | ス イ ス       | 百株<br>751.96<br>(-)          | 千スイス・フラン<br>5,111<br>(△16)     | 百株<br>627.86           | 千スイス・フラン<br>3,934      |               |
|         | デ ン マ ー ク   | 百株<br>133.16<br>(-)          | 千デンマーク・クローネ<br>6,568<br>(-)    | 百株<br>109.54           | 千デンマーク・クローネ<br>5,330   |               |
|         | ノ ル ウ ェ ー   | 百株<br>235.77<br>(-)          | 千ノルウェー・クローネ<br>3,027<br>(-)    | 百株<br>149.86           | 千ノルウェー・クローネ<br>2,383   |               |
|         | ス ウ ェ ー デ ン | 百株<br>1,039.86<br>(19.55)    | 千スウェーデン・クローナ<br>14,218<br>(△7) | 百株<br>838.12           | 千スウェーデン・クローナ<br>10,625 |               |
|         | ユ<br>ロ<br>圏 | ア イ ル ラ ン ド                  | 百株<br>97.08<br>(0.07)          | 千ユーロ<br>203<br>(-)     | 百株<br>34.72            | 千ユーロ<br>149   |
|         |             | オ ラ ン ダ                      | 百株<br>835.01<br>(-)            | 千ユーロ<br>3,514<br>(-)   | 百株<br>717.58           | 千ユーロ<br>2,711 |
|         |             | ベ ル ギ ー                      | 百株<br>111.8<br>(-)             | 千ユーロ<br>754<br>(-)     | 百株<br>95.52            | 千ユーロ<br>542   |
|         |             | ル ク セ ン ブ ル グ                | 百株<br>81.24<br>(-)             | 千ユーロ<br>128<br>(-)     | 百株<br>30.61            | 千ユーロ<br>75    |
|         |             | フ ラ ン ス                      | 百株<br>1,082.7<br>(4.02)        | 千ユーロ<br>5,028<br>(△1)  | 百株<br>914.63           | 千ユーロ<br>3,802 |
|         |             | ド イ ツ                        | 百株<br>1,068.68<br>(4.32)       | 千ユーロ<br>4,428<br>(△16) | 百株<br>840.29           | 千ユーロ<br>3,309 |
|         |             | ポ ル ト ガ ル                    | 百株<br>97.98<br>(-)             | 千ユーロ<br>47<br>(-)      | 百株<br>69.29            | 千ユーロ<br>25    |
|         |             | ス ペ イ ン                      | 百株<br>2,106.55<br>(778.58)     | 千ユーロ<br>1,444<br>(15)  | 百株<br>2,335.82         | 千ユーロ<br>1,069 |
| イ タ リ ア |             | 百株<br>1,668.94<br>(-)        | 千ユーロ<br>857<br>(-)             | 百株<br>837.76           | 千ユーロ<br>603            |               |

|     |             |        | 買 付                    |                    | 売 付          |             |
|-----|-------------|--------|------------------------|--------------------|--------------|-------------|
|     |             |        | 株 数                    | 金 額                | 株 数          | 金 額         |
| 外 国 | ユ<br>ー<br>ロ | フィンランド | 百株<br>396.71<br>(3.36) | 千ユーロ<br>439<br>(-) | 百株<br>275.38 | 千ユーロ<br>271 |
|     |             | オーストリア | 百株<br>13.35<br>(-)     | 千ユーロ<br>46<br>(△3) | 百株<br>9.08   | 千ユーロ<br>28  |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は株式分割、増資割当および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。



## (2) 投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄                              | 買付額      |          | 売付額   |          |
|---------------------------------|----------|----------|-------|----------|
|                                 | □数       | 金額       | □数    | 金額       |
| アメリカ                            | 千□       | 千アメリカ・ドル | 千□    | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT    | 0.664    | 100      | 0.503 | 72       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| BOSTON PROPERTIES INC           | 0.713    | 97       | 0.671 | 88       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC       | 1.699    | 71       | -     | -        |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT       | 9.679    | 88       | 8.319 | 74       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| PROLOGIS INC                    | 2.614    | 224      | 2.076 | 170      |
|                                 | (0.828)  | (-)      | (-)   | (-)      |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC       | 0.81     | 171      | 0.708 | 145      |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| CAMDEN PROPERTY TRUST           | 0.223    | 23       | -     | -        |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| EQUINIX INC                     | 0.357    | 199      | 0.239 | 133      |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC  | 0.487    | 26       | -     | -        |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| DUKE REALTY TRUST               | 3.039    | 99       | 2.145 | 67       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 1.653    | 234      | 1.257 | 176      |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC        | 0.233    | 74       | 0.232 | 64       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| EQUITY RESIDENTIAL              | 1.342    | 112      | 1.135 | 88       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST       | 0.589    | 78       | 0.352 | 46       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC       | 3.176    | 108      | 2.026 | 67       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| SBA COMMUNICATIONS CORP         | 0.32     | 81       | 0.244 | 63       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| WELLTOWER INC                   | 1.209    | 103      | 0.66  | 52       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| KIMCO REALTY                    | 0.854    | 15       | -     | -        |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| LIBERTY PROPERTY TRUST          | 0.698    | 35       | 0.34  | 21       |
|                                 | (△1.227) | (-)      | (-)   | (-)      |
| IRON MOUNTAIN INC               | 0.703    | 22       | -     | -        |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| THE MACERICH COMPANY            | 0.756    | 25       | 1.379 | 36       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES     | 1.459    | 156      | 0.749 | 66       |
|                                 | (0.758)  | (-)      | (-)   | (-)      |
| HOST HOTELS & RESORTS INC       | 1.723    | 29       | 2.211 | 32       |
|                                 | (-)      | (-)      | (-)   | (-)      |

| 銘柄   | 買付額     |             | 売付額    |             |
|--|---------|-------------|--------|-------------|
|  | □数      | 金額          | □数     | 金額          |
| <b>アメリカ</b>                                | 千□      | 千アメリカ・ドル    | 千□     | 千アメリカ・ドル    |
| MID AMERICA                                | 0.912   | 114         | 0.746  | 93          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| REALTY INCOME CORP                         | 1.436   | 107         | 1.126  | 76          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| REGENCY CENTERS CORP                       | 0.727   | 49          | 0.623  | 35          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| UDR INC                                    | 1.964   | 87          | 1.494  | 65          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| SIMON PROPERTY GROUP INC                   | 0.816   | 128         | 0.503  | 69          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| PUBLIC STORAGE                             | 0.408   | 100         | 0.289  | 59          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| SUN COMMUNITIES INC                        | 1.136   | 158         | 0.406  | 62          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| VENTAS INC                                 | 1.419   | 99          | 1.036  | 65          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| VORNADO REALTY TRUST                       | 1.114   | 73          | 1.285  | 74          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| WEYERHAEUSER CO                            | 1.744   | 48          | 1.264  | 36          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| EXTRA SPACE STORAGE INC                    | 1.253   | 142         | 0.974  | 107         |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| DIGITAL REALTY TRUST INC                   | 0.956   | 127         | 0.353  | 42          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST                   | 3.874   | 80          | -      | -           |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| AGNC INVESTMENT CORP                       | 1.045   | 18          | -      | -           |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| VEREIT INC                                 | 3.32    | 31          | -      | -           |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| AMERICAN TOWER CORP                        | 1.857   | 411         | 1.412  | 309         |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| WP CAREY INC                               | 1.35    | 106         | 0.805  | 62          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| INVITATION HOMES INC                       | 3.498   | 91          | 0.953  | 21          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC               | -       | -           | 0.945  | 18          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| VICI PROPERTIES INC                        | 3.569   | 87          | -      | -           |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| <b>カナダ</b>                                 | 千□      | 千カナダ・ドル     | 千□     | 千カナダ・ドル     |
| CANADIAN APT PPTYS REIT                    | 1.327   | 73          | 0.956  | 53          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | -       | -           | -      | -           |
|  | (1.227) | (26)        | (-)    | (-)         |
| <b>オーストラリア</b>                             | 千□      | 千オーストラリア・ドル | 千□     | 千オーストラリア・ドル |
| MIRVAC GROUP                               | 26.237  | 82          | 25.804 | 69          |
|  | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |

| 銘柄  | 買付額     |             | 売付額    |             |
|---|---------|-------------|--------|-------------|
|   | □数      | 金額          | □数     | 金額          |
| <b>オーストラリア</b>                            | 千□      | 千オーストラリア・ドル | 千□     | 千オーストラリア・ドル |
| GPT GROUP                                 | 5.714   | 35          | 8.18   | 47          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| STOCKLAND                                 | 10.059  | 44          | 14.765 | 68          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| DEXUS                                     | 3.103   | 38          | 3.995  | 48          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| GOODMAN GROUP                             | 3.903   | 54          | 2.128  | 30          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| VICINITY CENTRES                          | 16.882  | 44          | -      | -           |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| SCENTRE GROUP                             | 13.674  | 55          | 14.242 | 49          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| <b>香港</b>                                 | 千□      | 千香港・ドル      | 千□     | 千香港・ドル      |
| LINK REIT                                 | 6       | 551         | 4.8    | 366         |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| HKT TRUST AND HKT LTD                     | 12      | 150         | -      | -           |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| <b>シンガポール</b>                             | 千□      | 千シンガポール・ドル  | 千□     | 千シンガポール・ドル  |
| CAPITALAND MALL TRUST                     | 14.5    | 38          | 15.3   | 29          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT                 | 16      | 50          | 16.8   | 51          |
|   | (-)     | (△0.35753)  | (-)    | (-)         |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST               | 44.2    | 90          | 38.5   | 76          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR              | -       | -           | -      | -           |
|   | (-)     | (△0.09104)  | (-)    | (-)         |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST                | 14.1    | 34          | -      | -           |
|   | (-)     | (△0.00423)  | (-)    | (-)         |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS | -       | -           | 3.883  | 0.96406     |
|   | (3.883) | (-)         | (-)    | (-)         |
| <b>イギリス</b>                               | 千□      | 千イギリス・ポンド   | 千□     | 千イギリス・ポンド   |
| HAMMERSON PLC                             | -       | -           | 4.94   | 13          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| <b>ユーロ (オランダ)</b>                         | 千□      | 千ユーロ        | 千□     | 千ユーロ        |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD                 | 0.6     | 78          | 0.589  | 72          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |
| <b>ユーロ (フランス)</b>                         | 千□      | 千ユーロ        | 千□     | 千ユーロ        |
| GECINA SA                                 | 0.21    | 29          | 0.195  | 31          |
|   | (-)     | (-)         | (-)    | (-)         |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### (3) 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<br>株 式 先 物 取 引 | 百万円<br>14,584 | 百万円<br>14,648 | 百万円<br>-  | 百万円<br>- |

(注) 金額は受渡代金です。

### ■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         | 28,091,549千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 31,956,895千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)       | 0.87         |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

### ■利害関係人との取引状況等 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

### (1) 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     | 千アメリカ・ドル | 千円        |                    |
| AMAZON.COM INC                     | 27.7    | 31.84  | 7,538    | 801,791   | インターネット販売・通信販売     |
| ABBOTT LABORATORIES                | 116.44  | 133.91 | 1,258    | 133,866   | ヘルスケア機器・用品         |
| AES CORP                           | 39.02   | 52.97  | 64       | 6,828     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ABIOMED INC                        | 2.99    | 2.84   | 53       | 5,688     | ヘルスケア機器・用品         |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP        | 60.71   | 66.98  | 811      | 86,364    | 情報技術サービス           |
| ADVANCED MICRO DEVICES             | 63.14   | 80.22  | 416      | 44,324    | 半導体・半導体製造装置        |
| ADOBE INC                          | 32.66   | 36.65  | 1,344    | 142,974   | ソフトウェア             |
| CHUBB LTD                          | 30.34   | 34.23  | 338      | 36,039    | 保険                 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC       | 14.77   | 16.73  | 379      | 40,356    | 化学                 |
| ALLEGHANY CORP                     | 0.88    | 1.24   | 63       | 6,740     | 保険                 |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC           | —       | 5.1    | 63       | 6,705     | バイオテクノロジー          |
| RALPH LAUREN CORP                  | 3.25    | 2.87   | 20       | 2,143     | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| ALLSTATE CORP                      | 23.21   | 24.53  | 247      | 26,311    | 保険                 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 49.15   | 54.1   | 718      | 76,408    | コンピュータ・ソフトウェア      |
| AMGEN INC                          | 43.19   | 44.93  | 1,048    | 111,502   | バイオテクノロジー          |
| HESS CORP                          | 19.4    | 20.05  | 93       | 9,894     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| AMERICAN EXPRESS CO                | 48.65   | 52.76  | 457      | 48,669    | 消費者金融              |
| AMERICAN ELECTRIC POWER            | 32.14   | 38.52  | 302      | 32,202    | 電力                 |
| AFLAC INC                          | 50.32   | 55.74  | 199      | 21,265    | 保険                 |
| AMERICAN INTL GROUP                | 60.06   | 60.11  | 153      | 16,315    | 保険                 |
| AMERCO                             | 0.51    | 0.51   | 14       | 1,538     | 陸運・鉄道              |
| ANALOG DEVICES                     | 25.4    | 28.64  | 304      | 32,395    | 半導体・半導体製造装置        |
| ANADARKO PETROLEUM CORP            | 34.4    | —      | —        | —         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC        | 15.16   | 17.01  | 164      | 17,534    | バイオテクノロジー          |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 61.95   | 57.8   | 164      | 17,532    | 建設関連製品             |
| JONES LANG LASALLE INC             | 2.82    | 4.06   | 41       | 4,445     | 不動産管理・開発           |
| VALERO ENERGY CORP                 | 28.73   | 27.8   | 170      | 18,113    | 石油・ガス・消耗燃料         |
| APACHE CORP                        | 27.87   | 27.01  | 32       | 3,412     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ANSYS INC                          | 6.07    | 6.5    | 169      | 18,027    | ソフトウェア             |
| APPLE INC                          | 316.09  | 335.77 | 10,198   | 1,084,731 | コンピュータ・周辺機器        |
| APPLIED MATERIALS INC              | 65.81   | 70.5   | 361      | 38,429    | 半導体・半導体製造装置        |
| ALBEMARLE CORP                     | 6.39    | 7.2    | 43       | 4,574     | 化学                 |
| ARCHER—DANIELS—MIDLAND CO          | 38.11   | 40.96  | 142      | 15,143    | 食品                 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP         | 6.56    | 7.33   | 52       | 5,594     | 電力                 |
| AMEREN CORP                        | 16.62   | 20.5   | 142      | 15,186    | 総合公益事業             |
| ARROW ELECTRONICS INC              | 5.12    | 5.24   | 32       | 3,463     | 電子装置・機器・部品         |
| AUTOLIV INC                        | 5.1     | 6.15   | 35       | 3,791     | 自動車部品              |
| AUTODESK INC                       | 14.69   | 16.75  | 308      | 32,780    | ソフトウェア             |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING          | 29.26   | 32.81  | 484      | 51,566    | 情報技術サービス           |
| AUTOZONE INC                       | 1.8     | 1.67   | 169      | 17,978    | 専門小売り              |
| AVERY DENNISON CORP                | 5.13    | 6.58   | 68       | 7,300     | 容器・包装              |
| BALL CORP                          | 22.96   | 23.67  | 155      | 16,588    | 容器・包装              |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC—CL B        | 85.88   | 99.3   | 1,722    | 183,221   | 各種金融サービス           |

| 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     | 千アメリカ・ドル | 千円      |                         |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP      | 66.94   | 63.29  | 220      | 23,459  | 資本市場                    |
| BAXTER INTERNATIONAL INC          | 34.36   | 37.24  | 329      | 35,029  | ヘルスケア機器・用品              |
| BECTON DICKINSON & CO             | 17.88   | 20.59  | 527      | 56,117  | ヘルスケア機器・用品              |
| AMETEK INC                        | 16.78   | 16.06  | 133      | 14,230  | 電気設備                    |
| VERIZON COMM INC                  | 273.84  | 313    | 1,739    | 185,029 | 各種電気通信サービス              |
| WR BERKLEY CORP                   | 8.53    | 11.98  | 61       | 6,514   | 保険                      |
| BEST BUY CO INC                   | 17.61   | 16.9   | 128      | 13,705  | 専門小売り                   |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A         | -       | 1.59   | 73       | 7,786   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| YUM! BRANDS INC                   | 21.75   | 22.42  | 189      | 20,173  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| FIRSTENERGY CORP                  | 33.06   | 39.65  | 159      | 16,957  | 電力                      |
| H&R BLOCK INC                     | 12.08   | -      | -        | -       | 各種消費者サービス               |
| BOEING CO                         | 35.77   | 40.48  | 520      | 55,389  | 航空宇宙・防衛                 |
| ROBERT HALF INTL INC              | 7.21    | 10.54  | 47       | 5,062   | 専門サービス                  |
| BORGWARNER INC                    | 12.26   | 15.82  | 44       | 4,684   | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP            | 93.02   | 106.28 | 393      | 41,824  | ヘルスケア機器・用品              |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC       | 10      | 9.31   | 66       | 7,124   | 航空貨物・物流サービス             |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE     | 6.7     | 7.8    | 100      | 10,683  | 娯楽                      |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC  | 1.82    | 1.81   | 132      | 14,106  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO           | 108.95  | 177.19 | 1,081    | 115,035 | 医薬品                     |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP INC     | 3.16    | -      | -        | -       | 資本市場                    |
| INGREDION INC                     | 4.17    | 4.18   | 33       | 3,597   | 食品                      |
| ONEOK INC                         | 28      | 33.6   | 99       | 10,631  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC      | 4.41    | 6.44   | 40       | 4,265   | 保険                      |
| UNITED RENTALS INC                | 4.88    | 6.57   | 74       | 7,877   | 商社・流通業                  |
| SEMPRA ENERGY                     | 17.96   | 21.46  | 265      | 28,241  | 総合公益事業                  |
| FEDEX CORP                        | 17.07   | 18.87  | 220      | 23,429  | 航空貨物・物流サービス             |
| VERISIGN INC                      | 7.89    | 8.26   | 174      | 18,605  | 情報技術サービス                |
| AMPHENOL CORP                     | 20.93   | 23.28  | 203      | 21,601  | 電子装置・機器・部品              |
| BROWN-FORMAN CORP                 | 15.6    | 23.22  | 150      | 15,966  | 飲料                      |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC            | 92.54   | 97.08  | 53       | 5,699   | メディア                    |
| CSX CORP                          | 54.71   | 55.91  | 357      | 38,010  | 陸運・鉄道                   |
| CABOT OIL & GAS CORP              | 25.82   | 31.92  | 63       | 6,783   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAMPBELL SOUP CO                  | 10.59   | 10.72  | 53       | 5,728   | 食品                      |
| SEAGATE TECHNOLOGY                | 16.06   | 18.96  | 92       | 9,824   | コンピュータ・周辺機器             |
| CONSTELLATION BRANDS INC          | 11.23   | 12.73  | 209      | 22,309  | 飲料                      |
| CARDINAL HEALTH INC               | 21.24   | 21.59  | 104      | 11,141  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED       | 29.02   | 30.08  | 40       | 4,328   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CATERPILLAR INC                   | 39.84   | 41.88  | 449      | 47,790  | 機械                      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 8.82    | 8.65   | 92       | 9,863   | ソフトウェア                  |
| CELGENE CORP                      | 47.45   | -      | -        | -       | バイオテクノロジー               |
| CITRIX SYSTEMS INC                | 9.61    | 9.19   | 138      | 14,728  | ソフトウェア                  |
| CENTURYLINK INC                   | 67.6    | 72.53  | 69       | 7,344   | 各種電気通信サービス              |
| CERNER CORP                       | 20.58   | 24.48  | 163      | 17,442  | ヘルスケア・テクノロジー            |
| JPMORGAN CHASE & CO               | 219.97  | 236.55 | 2,157    | 229,479 | 銀行                      |
| CHURCH & DWIGHT CO INC            | 16.81   | 18.48  | 133      | 14,226  | 家庭用品                    |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP         | 11.05   | 12.4   | 68       | 7,255   | 保険                      |
| CINTAS CORP                       | 6.5     | 6.54   | 139      | 14,843  | 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  |                   |
| (アメリカ)                         | 百株      | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円      |                   |
| CISCO SYSTEMS INC              | 298.61  | 321.53 | 1,330    | 141,476 | 通信機器              |
| CLOROX COMPANY                 | 8.67    | 9.45   | 190      | 20,302  | 家庭用品              |
| COCA-COLA CO/THE               | 267.63  | 307.73 | 1,372    | 145,976 | 飲料                |
| COPART INC                     | 12.31   | 16.9   | 137      | 14,658  | 商業サービス・用品         |
| COGNEX CORP                    | 10.14   | 13.31  | 74       | 7,885   | 電子装置・機器・部品        |
| COLGATE-PALMOLIVE CO           | 55.21   | 61.93  | 426      | 45,317  | 家庭用品              |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A    | 20.23   | 21.65  | 186      | 19,798  | ホテル・レストラン・レジャー    |
| COMERICA INC                   | 11.16   | 11.71  | 37       | 4,031   | 銀行                |
| NRG ENERGY, INC.               | 17.88   | 19.89  | 63       | 6,794   | 電力                |
| COMCAST CORP-CL A              | 304.71  | 343.99 | 1,223    | 130,175 | メディア              |
| CONAGRA BRANDS INC             | 33.99   | 36.11  | 119      | 12,739  | 食品                |
| CONSOLIDATED EDISON INC        | 20.61   | 24.79  | 183      | 19,529  | 総合公益事業            |
| CMS ENERGY CORP                | 20.29   | 23.85  | 130      | 13,835  | 総合公益事業            |
| COOPER COS INC                 | 3.52    | 4.03   | 122      | 13,026  | ヘルスケア機器・用品        |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO       | 13.82   | 11.3   | 42       | 4,519   | 飲料                |
| CORNING INC                    | 54.7    | 53.34  | 111      | 11,885  | 電子装置・機器・部品        |
| SEALED AIR CORP                | 9.33    | 15.52  | 44       | 4,709   | 容器・包装             |
| HEICO CORP-CL A                | -       | 5.23   | 35       | 3,751   | 航空宇宙・防衛           |
| CUMMINS INC                    | 10.69   | 10.57  | 164      | 17,506  | 機械                |
| DR HORTON INC                  | 26.14   | 25.77  | 121      | 12,926  | 家庭用耐久財            |
| DANAHER CORP                   | 41.89   | 47.27  | 772      | 82,191  | ヘルスケア機器・用品        |
| MOODY'S CORP                   | 11.72   | 12.8   | 317      | 33,720  | 資本市場              |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 39.17   | 41.65  | 244      | 26,030  | 情報技術サービス          |
| TARGET CORP                    | 33.36   | 38.51  | 436      | 46,431  | 複合小売り             |
| DEERE & CO                     | 20.57   | 22.72  | 308      | 32,864  | 機械                |
| MORGAN STANLEY                 | 87.98   | 91.42  | 354      | 37,736  | 資本市場              |
| REPUBLIC SERVICES INC          | 15.68   | 18.32  | 148      | 15,823  | 商業サービス・用品         |
| COSTAR GROUP INC               | 2.68    | 2.83   | 180      | 19,233  | 専門サービス            |
| THE WALT DISNEY CO             | 119.94  | 136.47 | 1,440    | 153,234 | 娯楽                |
| DOLLAR TREE INC                | 16.16   | 18.42  | 141      | 15,024  | 複合小売り             |
| DOVER CORP                     | 10.75   | 10.27  | 93       | 9,947   | 機械                |
| OMNICOM GROUP                  | 15.47   | 16.93  | 90       | 9,657   | メディア              |
| DTE ENERGY CO                  | 12.17   | 14.1   | 139      | 14,804  | 総合公益事業            |
| DUKE ENERGY CORP               | 46.75   | 53.63  | 430      | 45,809  | 電力                |
| FLOWERVE CORP                  | 8.11    | 13.74  | 37       | 4,008   | 機械                |
| DARDEN RESTAURANTS INC         | 8.72    | 8.88   | 62       | 6,661   | ホテル・レストラン・レジャー    |
| EBAY INC                       | 63.88   | 57.51  | 237      | 25,305  | インターネット販売・通信販売    |
| BANK OF AMERICA CORP           | 618.04  | 644.26 | 1,471    | 156,507 | 銀行                |
| CITIGROUP INC                  | 161.99  | 164.03 | 732      | 77,879  | 銀行                |
| EASTMAN CHEMICAL CO            | 10.87   | 10.87  | 65       | 6,991   | 化学                |
| E*TRADE FINANCIAL CORP         | 19.04   | 19.29  | 77       | 8,200   | 資本市場              |
| EATON CORP PLC                 | 29.64   | 30.9   | 248      | 26,377  | 電気設備              |
| EATON VANCE CORP               | 6.99    | 6.42   | 23       | 2,456   | 資本市場              |
| CADENCE DESIGN SYS INC         | 20.03   | 21.76  | 177      | 18,832  | ソフトウェア            |
| DISH NETWORK CORP              | 13.51   | 17.71  | 41       | 4,398   | メディア              |
| ECOLAB INC                     | 17.13   | 19.64  | 381      | 40,549  | 化学                |
| PERKINELMER INC                | -       | 8.52   | 79       | 8,405   | ライフサイエンス・ツール/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     | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                         |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 20.46   | 20.66  | 241       | 25,665      | 娯楽                      |
| SALESFORCE.COM INC           | 50.63   | 62.98  | 1,070     | 113,808     | ソフトウェア                  |
| ERIE INDEMNITY CO            | —       | 1.88   | 34        | 3,692       | 保険                      |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 42.62   | 44.83  | 247       | 26,348      | 電気設備                    |
| ATMOS ENERGY CORP            | 8.18    | 8.94   | 86        | 9,164       | ガス                      |
| ENTERGY CORP                 | 12.44   | 14.4   | 133       | 14,208      | 電力                      |
| EOG RESOURCES INC            | 39.04   | 43.44  | 209       | 22,320      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| EQUIFAX INC                  | 7.09    | 8.88   | 131       | 14,007      | 専門サービス                  |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE     | 14.89   | 15.76  | 270       | 28,821      | パーソナル用品                 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL     | 12.64   | 13.28  | 98        | 10,505      | 航空貨物・物流サービス             |
| EXXON MOBIL CORP             | 281.32  | 318.65 | 1,409     | 149,936     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FMC CORP                     | 9.85    | 10.69  | 100       | 10,700      | 化学                      |
| NEXTERA ENERGY INC           | 30.98   | 36.92  | 828       | 88,149      | 電力                      |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | —       | 2.69   | 74        | 7,889       | 資本市場                    |
| ASSURANT INC                 | 3.27    | 5.11   | 50        | 5,358       | 保険                      |
| FASTENAL CO                  | 19.91   | 44.71  | 170       | 18,155      | 商社・流通業                  |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 47.57   | 54.88  | 95        | 10,115      | 銀行                      |
| M&T BANK CORP                | 9.26    | 9.22   | 93        | 9,965       | 銀行                      |
| FISERV INC                   | 27.43   | 43.79  | 469       | 49,984      | 情報技術サービス                |
| FLIR SYSTEMS INC             | 8.5     | 8.47   | 40        | 4,315       | 電子装置・機器・部品              |
| MACY'S INC                   | 18.06   | —      | —         | —           | 複合小売り                   |
| FORD MOTOR CO                | 253.23  | 306.27 | 149       | 15,863      | 自動車                     |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 23.58   | 23.58  | 42        | 4,549       | 資本市場                    |
| FREEPORT—MCMORAN INC         | 96.42   | 121.3  | 108       | 11,572      | 金属・鉱業                   |
| FLEX LTD                     | 33.05   | 38.09  | 35        | 3,767       | 電子装置・機器・部品              |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 12.8    | 13.48  | 115       | 12,241      | 保険                      |
| GAP INC/THE                  | 13.63   | 26.72  | 19        | 2,108       | 専門小売り                   |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 13.05   | 18.36  | 75        | 8,018       | ヘルスケア機器・用品              |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 16.65   | 18.92  | 240       | 25,582      | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL MILLS INC            | 40.41   | 45.45  | 267       | 28,409      | 食品                      |
| GENUINE PARTS CO             | 10.45   | 9.85   | 72        | 7,723       | 販売                      |
| GILEAD SCIENCES INC          | 86.67   | 95.83  | 743       | 79,103      | バイオテクノロジー               |
| GARTNER INC                  | 6.45    | 7.49   | 92        | 9,863       | 情報技術サービス                |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    | 13.9    | —      | —         | —           | 自動車部品                   |
| MCKESSON CORP                | 13.53   | 11.18  | 150       | 16,002      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| NVIDIA CORP                  | 38.72   | 43.96  | 1,340     | 142,544     | 半導体・半導体製造装置             |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 581.37  | 661.12 | 403       | 42,963      | コンプロマリット                |
| VWV GRAINGER INC             | 2.81    | 3.46   | 97        | 10,345      | 商社・流通業                  |
| HALLIBURTON CO               | 61.96   | 62.66  | 62        | 6,671       | エネルギー設備・サービス            |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 28.1    | 28.18  | 174       | 18,609      | 飲料                      |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 22.3    | 24.04  | 438       | 46,617      | 資本市場                    |
| HARLEY—DAVIDSON INC          | 9.78    | 5.42   | 11        | 1,178       | 自動車                     |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | —       | 16.85  | 307       | 32,705      | 航空宇宙・防衛                 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 7.99    | —      | —         | —           | 航空宇宙・防衛                 |
| HASBRO INC                   | 7.09    | 10.1   | 69        | 7,345       | レジャー用品                  |
| HENRY SCHEIN INC             | 9       | 11.38  | 61        | 6,522       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HEICO CORP                   | —       | 2.56   | 21        | 2,316       | 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     | 千アメリカ・ドル | 千円      |                         |
| HELMERICH & PAYNE INC          | 6.3     | —      | —        | —       | エネルギー設備・サービス            |
| HERSHEY FOODS CORP             | 9.95    | 11.7   | 152      | 16,243  | 食品                      |
| HP INC                         | 107.92  | 104.29 | 155      | 16,582  | コンピュータ・周辺機器             |
| F5 NETWORKS INC                | 3.56    | 5.01   | 71       | 7,604   | 通信機器                    |
| CROWN HOLDINGS INC NPR         | 7.95    | 10.53  | 65       | 6,995   | 容器・包装                   |
| UNITED THERAPEUTICS CORP       | 2.55    | —      | —        | —       | バイオテクノロジー               |
| JUNIPER NETWORKS INC           | 26.24   | 26.24  | 60       | 6,452   | 通信機器                    |
| HOLLYFRONTIER CORP             | 9.84    | 12.21  | 34       | 3,676   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HOLOGIC INC                    | 19.69   | 21.99  | 116      | 12,381  | ヘルスケア機器・用品              |
| UNUM GROUP                     | 12.85   | 17.07  | 25       | 2,679   | 保険                      |
| HOME DEPOT INC                 | 75.13   | 82.52  | 1,893    | 201,384 | 専門小売り                   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC    | 12.46   | 13.28  | 122      | 12,994  | バイオテクノロジー               |
| HORMEL FOODS CORP              | 17.12   | 20.97  | 97       | 10,391  | 食品                      |
| CENTERPOINT ENERGY INC         | 35.2    | 35.93  | 63       | 6,806   | 総合公益事業                  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC       | 2.13    | 2.9    | 55       | 5,941   | 建設関連製品                  |
| HUMANA INC                     | 9.3     | 10.03  | 372      | 39,622  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 5.13    | 6.81   | 68       | 7,250   | 陸運・鉄道                   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC      | 80.25   | 86.07  | 71       | 7,552   | 銀行                      |
| RED HAT INC                    | 11.75   | —      | —        | —       | ソフトウェア                  |
| NEKTAR THERAPEUTICS            | 10.61   | —      | —        | —       | 医薬品                     |
| BIOGEN INC                     | 13.51   | 13.67  | 429      | 45,655  | バイオテクノロジー               |
| IDEX CORP                      | 5.81    | 6.08   | 93       | 9,919   | 機械                      |
| ILLINOIS TOOL WORKS            | 20.39   | 24.62  | 386      | 41,098  | 機械                      |
| INTUIT INC                     | 16.44   | 19.71  | 553      | 58,865  | ソフトウェア                  |
| IDEXX LABORATORIES INC         | 6.06    | 5.95   | 175      | 18,622  | ヘルスケア機器・用品              |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC      | —       | 8.53   | 45       | 4,832   | バイオテクノロジー               |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC         | 16.63   | 16.54  | 134      | 14,254  | 建設関連製品                  |
| INTEL CORP                     | 303.22  | 329.1  | 1,947    | 207,113 | 半導体・半導体製造装置             |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES      | 5.01    | 7.31   | 95       | 10,129  | 化学                      |
| INTERNATIONAL PAPER CO         | 27.1    | 27.61  | 90       | 9,573   | 容器・包装                   |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC   | 22.56   | 32.46  | 52       | 5,617   | メディア                    |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC   | 7.51    | 9.53   | 74       | 7,961   | 建設・土木                   |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC    | 4.52    | 6.11   | 112      | 11,945  | 情報技術サービス                |
| INCYTE CORP                    | 10.63   | 13.52  | 130      | 13,872  | バイオテクノロジー               |
| JOHNSON & JOHNSON              | 178.2   | 199.04 | 2,937    | 312,446 | 医薬品                     |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP    | 25.05   | 28.77  | 100      | 10,682  | 保険                      |
| KLA CORPORATION                | 10.88   | 11.08  | 181      | 19,308  | 半導体・半導体製造装置             |
| DEVON ENERGY CORP              | 31.89   | 23.68  | 28       | 3,024   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KELLOGG CO                     | 18.3    | 18.29  | 114      | 12,195  | 食品                      |
| EAST WEST BANCORP INC          | 12.1    | 12.1   | 39       | 4,239   | 銀行                      |
| KEYCORP                        | 73.69   | 69.59  | 74       | 7,964   | 銀行                      |
| KIMBERLY—CLARK CORP            | 23.31   | 26.17  | 357      | 38,049  | 家庭用品                    |
| BLACKROCK INC/NEW YORK         | 8.05    | 8.69   | 432      | 45,972  | 資本市場                    |
| KOHL'S CORP                    | 9.83    | 12.91  | 23       | 2,457   | 複合小売り                   |
| KROGER CO                      | 53.1    | 62.39  | 203      | 21,685  | 食品・生活必需品小売り             |
| LAM RESEARCH CORP              | 10.68   | 11.09  | 274      | 29,208  | 半導体・半導体製造装置             |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC      | —       | 2.77   | 88       | 9,434   | 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     | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                         |
| PACKAGING CORP OF AMERICA     | 5.55    | 8.25   | 77        | 8,229       | 容器・包装                   |
| AKAMAI TECHNOLOGIES           | 12.3    | 13.31  | 133       | 14,241      | 情報技術サービス                |
| LEGGETT & PLATT INC           | 7.65    | 9.67   | 25        | 2,763       | 家庭用耐久財                  |
| LENNAR CORP                   | 21.15   | 20.48  | 104       | 11,074      | 家庭用耐久財                  |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 17.74   | 17.74  | 23        | 2,528       | 各種金融サービス                |
| ELI LILLY & CO                | 61.89   | 65.42  | 1,000     | 106,437     | 医薬品                     |
| L BRANDS INC                  | 13.87   | —      | —         | —           | 専門小売り                   |
| LINCOLN NATIONAL CORP         | 16.11   | 15.71  | 54        | 5,809       | 保険                      |
| UNITED PARCEL SERVICE—CL B    | 46.32   | 53.09  | 492       | 52,417      | 航空貨物・物流サービス             |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 22.06   | 23.21  | 182       | 19,378      | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| LOCKHEED MARTIN CORP          | 17.09   | 19.23  | 724       | 77,013      | 航空宇宙・防衛                 |
| LOEWS CORP                    | 19.56   | 18.2   | 55        | 5,873       | 保険                      |
| LOWE'S COS INC                | 54.44   | 58.21  | 651       | 69,292      | 専門小売り                   |
| DOMINION ENERGY INC           | 49.57   | 62.77  | 490       | 52,141      | 総合公益事業                  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL     | 36.2    | 37.52  | 56        | 5,958       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MCCORMICK & CO INC            | 8.33    | 9.2    | 147       | 15,740      | 食品                      |
| MCDONALD'S CORPORATION        | 51.54   | 57.06  | 1,033     | 109,919     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| S&P GLOBAL INC                | 16.91   | 18.45  | 545       | 58,002      | 資本市場                    |
| EVEREST RE GROUP LTD          | 2.4     | 3.21   | 55        | 5,934       | 保険                      |
| MANPOWERGROUP INC             | 3.81    | 3.81   | 26        | 2,771       | 専門サービス                  |
| MARKEL CORPORATION            | 0.98    | 1.02   | 85        | 9,069       | 保険                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 13.99   | 15.89  | 346       | 36,850      | ヘルスケア機器・用品              |
| MARSH & MCLENNAN COS          | 32.81   | 38.36  | 389       | 41,472      | 保険                      |
| MASCO CORP                    | 23.49   | 19.97  | 82        | 8,825       | 建設関連製品                  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 3.7     | 4.5    | 80        | 8,600       | 建設資材                    |
| MATTEL INC                    | 21.46   | —      | —         | —           | レジャー用品                  |
| METLIFE INC                   | 56.99   | 58.91  | 202       | 21,578      | 保険                      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS     | 19.47   | 18.92  | 99        | 10,635      | 半導体・半導体製造装置             |
| MEDTRONIC PLC                 | 89.42   | 101.38 | 1,003     | 106,684     | ヘルスケア機器・用品              |
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 48.04   | 58.29  | 426       | 45,319      | 娯楽                      |
| CVS HEALTH CORP               | 86.22   | 98.57  | 605       | 64,423      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MERCK & CO.INC.               | 172.04  | 192.65 | 1,456     | 154,906     | 医薬品                     |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION  | 25.1    | 24.18  | 38        | 4,109       | 半導体・半導体製造装置             |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS  | 7.24    | 7.16   | 114       | 12,198      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MICROSOFT CORP                | 484.12  | 547.52 | 10,052    | 1,069,180   | ソフトウェア                  |
| MICRON TECH INC               | 76.91   | 84.31  | 392       | 41,778      | 半導体・半導体製造装置             |
| MIDDLEBY CORP                 | 3.28    | 5.57   | 32        | 3,508       | 機械                      |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC      | 16.23   | 17.76  | 151       | 16,150      | 半導体・半導体製造装置             |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD  | 36.5    | 45.76  | 120       | 12,868      | 半導体・半導体製造装置             |
| 3M CO                         | 39.04   | 43.68  | 636       | 67,707      | コングロマリット                |
| MOHAWK INDUSTRIES INC         | 3.74    | 5.27   | 42        | 4,504       | 家庭用耐久財                  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC        | 11.74   | 13.25  | 180       | 19,195      | 通信機器                    |
| KANSAS CITY SOUTHERN          | 7.48    | 7.69   | 100       | 10,741      | 陸運・鉄道                   |
| MYLAN NV                      | 35.57   | 37.91  | 65        | 6,983       | 医薬品                     |
| ILLUMINA INC                  | 9.96    | 11.13  | 348       | 37,095      | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| XCEL ENERGY INC               | 34.51   | 39.49  | 236       | 25,184      | 電力                      |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC    | —       | 6.96   | 75        | 8,064       | バイオテクノロジー               |

| 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  |              |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円      |              |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 28.26   | 29.3   | 36       | 3,848   | エネルギー設備・サービス |
| NETAPP INC                   | 18.02   | 19.8   | 85       | 9,057   | コンピュータ・周辺機器  |
| NEWELL BRANDS INC            | 27.82   | 27.82  | 33       | 3,562   | 家庭用耐久財       |
| NEWMONT CORP                 | 32.51   | 59.34  | 383      | 40,746  | 金属・鉱業        |
| NVR INC                      | 0.2     | 0.27   | 81       | 8,615   | 家庭用耐久財       |
| NIKE INC—CL B                | 85.42   | 94.25  | 834      | 88,776  | 繊維・アパレル・贅沢品  |
| NOBLE ENERGY INC             | 28.25   | 46.25  | 40       | 4,358   | 石油・ガス・消耗燃料   |
| NORDSTROM INC                | 6.89    | 6.89   | 11       | 1,267   | 複合小売り        |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 18.83   | 19.74  | 334      | 35,604  | 陸運・鉄道        |
| EVERSOURCE ENERGY            | 21.63   | 24.25  | 188      | 20,025  | 電力           |
| NISOURCE INC                 | 21.34   | 32.8   | 75       | 7,988   | 総合公益事業       |
| TAPESTRY INC                 | 16.94   | 24.54  | 35       | 3,784   | 繊維・アパレル・贅沢品  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 14.81   | 16.26  | 120      | 12,787  | 資本市場         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 10.91   | 11.9   | 385      | 41,025  | 航空宇宙・防衛      |
| WELLS FARGO & CO             | 295.91  | 303.35 | 765      | 81,402  | 銀行           |
| NUCOR CORP                   | 22.42   | 18.99  | 77       | 8,262   | 金属・鉱業        |
| CHENIERE ENERGY INC          | 15.09   | 15.12  | 65       | 6,948   | 石油・ガス・消耗燃料   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 32.36   | 35.14  | 213      | 22,731  | 消費者金融        |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 51.64   | 68.1   | 94       | 10,053  | 石油・ガス・消耗燃料   |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 3.62    | 7.65   | 114      | 12,181  | 陸運・鉄道        |
| OGE ENERGY CORP              | 11.69   | 17.38  | 50       | 5,414   | 電力           |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 5.4     | 5.86   | 226      | 24,086  | 専門小売り        |
| ORACLE CORP                  | 174.69  | 173.98 | 915      | 97,333  | ソフトウェア       |
| PACCAR INC                   | 24.37   | 25.05  | 171      | 18,279  | 機械           |
| PTC INC                      | 6.59    | 9.26   | 65       | 6,978   | ソフトウェア       |
| EXELON CORP                  | 63.66   | 74.72  | 261      | 27,847  | 電力           |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 9.3     | 9.27   | 144      | 15,379  | 機械           |
| PAYCHEX INC                  | 22.25   | 23.49  | 159      | 17,006  | 情報技術サービス     |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 5.27    | 5.12   | 109      | 11,626  | ヘルスケア機器・用品   |
| PPL CORPORATION              | 47.11   | 56.16  | 136      | 14,508  | 電力           |
| PEPSICO INC                  | 93.93   | 105.62 | 1,389    | 147,779 | 飲料           |
| PENTAIR PLC                  | 9.78    | 10.79  | 36       | 3,928   | 機械           |
| PFIZER INC                   | 382.37  | 418.63 | 1,547    | 164,566 | 医薬品          |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | —       | 16     | 64       | 6,897   | 水道           |
| CONOCOPHILLIPS               | 77.56   | 81.28  | 344      | 36,671  | 石油・ガス・消耗燃料   |
| PVH CORP                     | 4.54    | 4.45   | 19       | 2,032   | 繊維・アパレル・贅沢品  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 11.59   | 12.87  | 111      | 11,911  | 石油・ガス・消耗燃料   |
| ALTRIA GROUP INC             | 125.9   | 142.02 | 498      | 53,019  | タバコ          |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 31.08   | 32.94  | 333      | 35,486  | 銀行           |
| BROWN & BROWN INC            | —       | 16.07  | 59       | 6,346   | 保険           |
| POLARIS INC                  | 3.48    | 2.5    | 17       | 1,814   | レジャー用品       |
| GARMIN LTD                   | 6.65    | 10.77  | 84       | 8,939   | 家庭用耐久財       |
| FLUOR CORP (NEW)             | 8.72    | —      | —        | —       | 建設・土木        |
| PPG INDUSTRIES INC           | 16.38   | 16.91  | 152      | 16,251  | 化学           |
| IPG PHOTONICS CORP           | 2.33    | 2.33   | 34       | 3,652   | 電子装置・機器・部品   |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 29.31   | 33.49  | 1,021    | 108,640 | 食品・生活必需品小売り  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 17.11   | 17.98  | 200      | 21,292  | 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     | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                         |
| QUEST DIAGNOSTICS                | 9.8     | 9.91   | 106       | 11,316      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO              | 164.96  | 188.44 | 2,113     | 224,816     | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CORP                 | 38.52   | 44.46  | 333       | 35,432      | 保険                      |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP     | 33.35   | 38.95  | 186       | 19,810      | 総合公益事業                  |
| PULTE GROUP INC                  | 15.87   | 20.43  | 57        | 6,123       | 家庭用耐久財                  |
| GLOBAL PAYMENTS INC              | 11.28   | 22.79  | 398       | 42,360      | 情報技術サービス                |
| QUALCOMM INC                     | 80.7    | 86.62  | 682       | 72,625      | 半導体・半導体製造装置             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC      | 9.89    | 8.9    | 57        | 6,098       | 資本市場                    |
| EXACT SCIENCES CORP              | —       | 12.17  | 100       | 10,724      | バイオテクノロジー               |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD       | 2.35    | 3.43   | 51        | 5,459       | 保険                      |
| REGENERON PHARMACEUTICALS        | 5.36    | 6.15   | 344       | 36,619      | バイオテクノロジー               |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC | 3.73    | 5.04   | 46        | 4,935       | 保険                      |
| RESMED INC                       | 9.94    | 10.49  | 168       | 17,929      | ヘルスケア機器・用品              |
| US BANCORP                       | 102.25  | 112.79 | 385       | 41,027      | 銀行                      |
| SEATTLE GENETICS INC /WA         | 6.54    | 8.64   | 141       | 15,002      | バイオテクノロジー               |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD           | 23.73   | 31.35  | 77        | 8,239       | 保険                      |
| ROSS STORES INC                  | 25.34   | 26.97  | 242       | 25,773      | 専門小売り                   |
| ROLLINS INC                      | 9.06    | 11.39  | 47        | 5,052       | 商業サービス・用品               |
| ROPER TECHNOLOGIES INC           | 7.04    | 7.84   | 279       | 29,701      | コンプロマリット                |
| ROCKWELL AUTOMATION INC          | 8.59    | 8.35   | 159       | 16,964      | 電気設備                    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD      | 11.65   | 12.69  | 48        | 5,132       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| RPM INTERNATIONAL INC            | —       | 9.9    | 66        | 7,107       | 化学                      |
| RAYTHEON COMPANY                 | 18.77   | —      | —         | —           | 航空宇宙・防衛                 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP       | 2.91    | 2.96   | 13        | 1,432       | 情報技術サービス                |
| ACCENTURE PLC—CL A               | 42.47   | 48     | 898       | 95,524      | 情報技術サービス                |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC       | 98.5    | 109.4  | 548       | 58,365      | 食品                      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC         | 8.92    | 9.55   | 184       | 19,618      | 保険                      |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC      | 17.93   | 19.83  | 189       | 20,205      | 保険                      |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION    | 22.14   | 46.48  | 601       | 63,990      | 情報技術サービス                |
| BOOKING HOLDINGS INC             | 3.1     | 3.18   | 459       | 48,836      | インターネット販売・通信販売          |
| SCHLUMBERGER LTD                 | 94.11   | 103.81 | 173       | 18,471      | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP            | 81.8    | 87.54  | 307       | 32,745      | 資本市場                    |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC       | 13.81   | 15.34  | 183       | 19,480      | ヘルスケア機器・用品              |
| BUNGE LTD                        | 8.28    | 10.99  | 39        | 4,251       | 食品                      |
| SEI INVESTMENTS CO               | 7.86    | 10.55  | 53        | 5,669       | 資本市場                    |
| ANTHEM INC                       | 17.28   | 19.2   | 510       | 54,265      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERISOURCEBERGEN CORP           | 11.48   | 11.39  | 101       | 10,750      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP        | 20.7    | 20.2   | 73        | 7,796       | 保険                      |
| SHERWIN—WILLIAMS CO/THE          | 5.72    | 6.23   | 329       | 35,023      | 化学                      |
| CENTENE CORP                     | 27.6    | 44.47  | 287       | 30,559      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SVB FINANCIAL GROUP              | 3.14    | 4.23   | 77        | 8,262       | 銀行                      |
| IAC INTERACTIVE CORP             | 5.42    | 5.88   | 139       | 14,825      | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SMITH (A.O.) CORP                | 8.51    | 8.24   | 35        | 3,795       | 建設関連製品                  |
| ACUITY BRANDS INC                | 2.37    | 4.12   | 34        | 3,708       | 電気設備                    |
| SNAP—ON INC                      | 3.31    | 4.56   | 55        | 5,927       | 機械                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC         | 28.38   | 30.33  | 172       | 18,297      | 保険                      |
| ADVANCE AUTO PARTS               | 4.36    | 5.09   | 60        | 6,475       | 専門小売り                   |

| 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     | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                         |
| EDISON INTERNATIONAL                     | 22.13   | 25.1   | 136       | 14,557      | 電力                      |
| SOUTHERN CO                              | 65.55   | 80.23  | 435       | 46,275      | 電力                      |
| TRUIST FINANCIAL CORP                    | 52.15   | 100.96 | 355       | 37,841      | 銀行                      |
| SOUTHWEST AIRLINES                       | 8.57    | 7.59   | 19        | 2,054       | 旅客航空輸送業                 |
| AT&T INC                                 | 482.31  | 552.37 | 1,595     | 169,728     | 各種電気通信サービス              |
| CHEVRON CORP                             | 127.28  | 142.52 | 1,320     | 140,427     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| STANLEY BLACK & DECKER INC               | 10.69   | 11.69  | 128       | 13,674      | 機械                      |
| STATE STREET CORP                        | 25.88   | 27.65  | 161       | 17,127      | 資本市場                    |
| STARBUCKS CORP                           | 82.45   | 89.57  | 680       | 72,402      | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STEEL DYNAMICS INC                       | 13.85   | 17.4   | 41        | 4,465       | 金属・鉱業                   |
| STRYKER CORP                             | 22.52   | 25.6   | 492       | 52,329      | ヘルスケア機器・用品              |
| NETFLIX INC                              | 29.1    | 33.16  | 1,447     | 153,959     | 娯楽                      |
| SUNTRUST BANKS INC                       | 31.83   | —      | —         | —           | 銀行                      |
| NORTONLIFELOCK INC                       | 43.18   | 41.98  | 88        | 9,456       | ソフトウェア                  |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 8.43    | 8.43   | 31        | 3,344       | 陸運・鉄道                   |
| SYNOPSIS INC                             | 9.04    | 11.65  | 185       | 19,694      | ソフトウェア                  |
| SYSCO CORP                               | 32.98   | 33.68  | 176       | 18,727      | 食品・生活必需品小売り             |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   | 7.66    | 8.77   | 470       | 49,991      | ヘルスケア機器・用品              |
| TELEFLEX INC                             | 2.69    | 3.66   | 125       | 13,362      | ヘルスケア機器・用品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES           | 65.28   | 86.32  | 99        | 10,604      | 医薬品                     |
| TERADYNE INC                             | —       | 13.74  | 85        | 9,123       | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXAS INSTRUMENTS INC                    | 64.91   | 71.25  | 809       | 86,125      | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXTRON INC                              | 17.75   | 15.86  | 40        | 4,331       | 航空宇宙・防衛                 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC             | 26.88   | 30.29  | 1,027     | 109,239     | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| TIFFANY & CO                             | 6.48    | 7.15   | 91        | 9,746       | 専門小売り                   |
| GLOBE LIFE INC                           | 8.45    | 7.22   | 54        | 5,815       | 保険                      |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC                | 11.6    | —      | —         | —           | 情報技術サービス                |
| DAVITA INC                               | 7.85    | 7.85   | 62        | 6,692       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TRACTOR SUPPLY CO                        | 7.16    | 8.05   | 84        | 9,004       | 専門小売り                   |
| TRIMBLE INC                              | 14.7    | 16.73  | 60        | 6,485       | 電子装置・機器・部品              |
| TYLER TECHNOLOGIES INC                   | —       | 2.99   | 99        | 10,576      | ソフトウェア                  |
| TYSON FOODS INC                          | 20.35   | 22.78  | 130       | 13,873      | 食品                      |
| UGI CORP                                 | 10.21   | 18.6   | 52        | 5,564       | ガス                      |
| MARATHON OIL CORP                        | 61.43   | 59.77  | 32        | 3,502       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| UNION PACIFIC CORP                       | 49.12   | 52.32  | 817       | 86,932      | 陸運・鉄道                   |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP               | 54.44   | 113.48 | 646       | 68,809      | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC                   | 63.89   | 71.61  | 2,040     | 217,068     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC            | 5.05    | 5.73   | 55        | 5,882       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC               | 6.61    | 6.46   | 75        | 8,034       | ヘルスケア機器・用品              |
| VF CORP                                  | 22.82   | 26.37  | 151       | 16,065      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VIACOMCBS INC                            | 23.55   | 39.52  | 64        | 6,901       | メディア                    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC               | 17.21   | 19.52  | 527       | 56,058      | バイオテクノロジー               |
| VULCAN MATERIALS CO                      | 9.47    | 9.51   | 97        | 10,335      | 建設資材                    |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC             | 53.81   | 58.71  | 238       | 25,389      | 食品・生活必需品小売り             |
| WALMART INC                              | 96.04   | 107.92 | 1,315     | 139,909     | 食品・生活必需品小売り             |
| WASTE MANAGEMENT INC                     | 28.72   | 32.72  | 331       | 35,305      | 商業サービス・用品               |
| WATERS CORP                              | 5.52    | 5.29   | 98        | 10,464      | ライフサイエンス・ツール/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    | 千アメリカ・ドル | 千円     |                         |
| ALLERGAN PLC                    | 22.43   | 24.88 | 480      | 51,069 | 医薬品                     |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES    | —       | 5.87  | 116      | 12,359 | ヘルスケア機器・用品              |
| JM SMUCKER CO/THE—NEW           | 8.17    | 8.96  | 101      | 10,819 | 食品                      |
| VAIL RESORTS INC                | 2.37    | 3.28  | 56       | 5,983  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESTERN DIGITAL CORP            | 17.15   | 22.14 | 92       | 9,854  | コンピュータ・周辺機器             |
| WABTEC CORP                     | 8.23    | 13.19 | 72       | 7,752  | 機械                      |
| WHIRLPOOL CORP                  | 3.8     | 4.91  | 52       | 5,582  | 家庭用耐久財                  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC          | 10.51   | 12.49 | 132      | 14,106 | 半導体・半導体製造装置             |
| WYNN RESORTS LTD                | 5.76    | 7.79  | 62       | 6,595  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| NASDAQ INC                      | 6.79    | 9.08  | 97       | 10,365 | 資本市場                    |
| CME GROUP INC                   | 23.5    | 27.12 | 484      | 51,485 | 資本市場                    |
| WILLIAMS COS INC                | 81.67   | 92.27 | 177      | 18,852 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| LKQ CORP                        | 18.7    | 24.81 | 62       | 6,649  | 販売                      |
| ALLIANT ENERGY CORP             | 17.59   | 18.2  | 84       | 8,950  | 電力                      |
| WEC ENERGY GROUP INC            | 21      | 22.92 | 195      | 20,752 | 総合公益事業                  |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP      | 19.54   | 20.03 | 73       | 7,797  | 資本市場                    |
| CARMAX INC                      | 10.39   | 13.66 | 99       | 10,587 | 専門小売り                   |
| XEROX CORP                      | 13.47   | —     | —        | —      | コンピュータ・周辺機器             |
| XILINX INC                      | 17      | 17.72 | 149      | 15,912 | 半導体・半導体製造装置             |
| CIMAREX ENERGY CO               | 5.56    | —     | —        | —      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TJX COMPANIES INC               | 83.54   | 92.1  | 446      | 47,509 | 専門小売り                   |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP         | —       | 3.64  | 85       | 9,053  | 電子装置・機器・部品              |
| ZIONS BANCORP NA                | 15.32   | 15.32 | 45       | 4,818  | 銀行                      |
| DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS | 20      | 20    | 9        | 1,021  | 食品・生活必需品小売り             |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD      | 68.49   | 68.49 | 27       | 2,950  | 不動産管理・開発                |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD   | 16.28   | 16.28 | 72       | 7,724  | コンプロマリット                |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD  | 16.61   | 16.61 | 36       | 3,837  | コンプロマリット                |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC     | 5.33    | 8.39  | 118      | 12,622 | バイオテクノロジー               |
| SIGNATURE BANK                  | 3.24    | 2.7   | 27       | 2,877  | 銀行                      |
| CBRE GROUP INC                  | 23.37   | 24.34 | 99       | 10,585 | 不動産管理・開発                |
| LIBERTY GLOBAL PLC              | 11.82   | 11.82 | 25       | 2,751  | メディア                    |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC       | 2.94    | —     | —        | —      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP          | 70.44   | 66.11 | 65       | 6,925  | 銀行                      |
| DOMINO'S PIZZA INC              | 2.34    | 3.03  | 111      | 11,832 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP          | 2.36    | 2.36  | 9        | 1,042  | 化学                      |
| T—MOBILE US INC                 | 22.74   | 32.46 | 309      | 32,898 | 無線通信サービス                |
| LAS VEGAS SANDS CORP            | 26.94   | 22.8  | 108      | 11,487 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MOSAIC CO/THE                   | 21.58   | 31.09 | 34       | 3,670  | 化学                      |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC        | —       | 2.63  | 126      | 13,447 | 資本市場                    |
| CELANESE CORP                   | 9.87    | 9.86  | 79       | 8,426  | 化学                      |
| DEXCOM INC                      | 5.2     | 6.42  | 259      | 27,610 | ヘルスケア機器・用品              |
| DISCOVERY INC—A                 | 9.57    | 9.57  | 19       | 2,089  | メディア                    |
| EXPEDIA GROUP INC               | 8.61    | 9.88  | 65       | 6,983  | インターネット販売・通信販売          |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC      | 13.76   | 13.25 | 36       | 3,881  | 化学                      |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC        | 10.09   | 9.28  | 112      | 12,015 | 資本市場                    |
| LIBERTY GLOBAL PLC—SERIES C     | 37.44   | 32.28 | 69       | 7,367  | メディア                    |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC   | 38.01   | 42.23 | 393      | 41,812 | 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     | 千アメリカ・ドル | 千円      |                         |
| UNDER ARMOUR INC—CLASS A           | 10.33   | 10.33  | 9        | 1,055   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VIACOM INC—CLASS B                 | 20.78   | —      | —        | —       | 娯楽                      |
| LIVE NATION                        | 8.62    | 8.34   | 32       | 3,492   | 娯楽                      |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC         | 1.47    | 2.04   | 183      | 19,473  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC      | 4.08    | 6.9    | 15       | 1,669   | 旅客航空輸送業                 |
| TRANSDIGM GROUP INC                | 3.3     | 3.66   | 118      | 12,634  | 航空宇宙・防衛                 |
| MASTERCARD INC                     | 61.23   | 67.78  | 1,887    | 200,751 | 情報技術サービス                |
| QURATE RETAIL INC                  | 25.34   | —      | —        | —       | インターネット販売・通信販売          |
| HANESBRANDS INC                    | 21.21   | 38.42  | 35       | 3,804   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| WESTERN UNION CO                   | 26.12   | 34.85  | 67       | 7,209   | 情報技術サービス                |
| OWENS CORNING                      | 6.53    | 10.82  | 45       | 4,798   | 建設関連製品                  |
| LEIDOS HOLDINGS INC                | 8.37    | 10.51  | 105      | 11,220  | 情報技術サービス                |
| AERCAP HOLDINGS NV                 | 7.38    | 10.53  | 29       | 3,163   | 商社・流通業                  |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC    | 6.27    | 8.77   | 16       | 1,750   | 航空宇宙・防衛                 |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT—ADR  | 21      | 13.1   | 20       | 2,172   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS     | 8.42    | 8.1    | 94       | 10,053  | 情報技術サービス                |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC      | 22.12   | 36.36  | 41       | 4,462   | 銀行                      |
| DELTA AIR LINES INC                | 10.35   | 10.63  | 23       | 2,451   | 旅客航空輸送業                 |
| INSULET CORP                       | —       | 4.97   | 106      | 11,373  | ヘルスケア機器・用品              |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK       | 5.78    | 5.78   | 7        | 836     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DISCOVER FINANCIAL                 | 23.5    | 25.63  | 103      | 11,034  | 消費者金融                   |
| TE CONNECTIVITY LTD                | 24.21   | 24.49  | 179      | 19,098  | 電子装置・機器・部品              |
| CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX    | 13.5    | 14.74  | 84       | 8,965   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WABCO HOLDING INC                  | 3.11    | 3.24   | 43       | 4,652   | 機械                      |
| LULULEMON ATHLETICA INC            | 6.96    | 8.66   | 195      | 20,815  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VMWARE INC                         | 5.34    | 6.89   | 91       | 9,768   | ソフトウェア                  |
| MERCADOLIBRE INC                   | 2.93    | 3.11   | 240      | 25,536  | インターネット販売・通信販売          |
| ULTA BEAUTY INC                    | 3.96    | 4.09   | 90       | 9,664   | 専門小売り                   |
| INVESCO LTD                        | 32.48   | 32.48  | 24       | 2,649   | 資本市場                    |
| MSCI INC                           | 6.4     | 6.41   | 214      | 22,777  | 資本市場                    |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL        | 103.68  | 117.76 | 825      | 87,850  | タバコ                     |
| VISA INC                           | 117.82  | 129.32 | 2,362    | 251,321 | 情報技術サービス                |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC        | 12.45   | 14.44  | 171      | 18,288  | 水道                      |
| DISCOVERY INC—C                    | 17.61   | 26.87  | 50       | 5,392   | メディア                    |
| MARATHON PETROLEUM CORP            | 46.74   | 48.73  | 149      | 15,953  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 8.39    | 12.5   | 67       | 7,156   | 建設関連製品                  |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE         | 132.57  | 152.86 | 228      | 24,289  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| XYLEM INC                          | 12.96   | 12.82  | 81       | 8,665   | 機械                      |
| ALKERMES PLC                       | 9.65    | —      | —        | —       | バイオテクノロジー               |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV       | 22.17   | 17.62  | 94       | 10,069  | 化学                      |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC  | 2.55    | 2.52   | 43       | 4,645   | 航空宇宙・防衛                 |
| SPLUNK INC                         | 10.07   | 10.52  | 158      | 16,854  | ソフトウェア                  |
| EPAM SYSTEMS INC                   | —       | 4.45   | 101      | 10,744  | 情報技術サービス                |
| HCA HEALTHCARE INC                 | 18.54   | 20.61  | 211      | 22,477  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC               | 11.11   | 11.62  | 183      | 19,560  | 専門サービス                  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC           | 3.55    | 5.02   | 54       | 5,843   | 医薬品                     |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 6.17    | 5.91   | 147      | 15,635  | 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     | 千アメリカ・ドル | 千円      |                      |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 11.43   | 12.12  | 123      | 13,133  | 銀行                   |
| CIT GROUP INC                        | 6.6     | —      | —        | —       | 銀行                   |
| NXP SEMICONDUCTOR NV                 | 22.95   | 21.83  | 224      | 23,835  | 半導体・半導体製造装置          |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP     | —       | 10.35  | 76       | 8,129   | 情報技術サービス             |
| TARGA RESOURCES CORP                 | 13.22   | 19.73  | 26       | 2,816   | 石油・ガス・消耗燃料           |
| LEAR CORP                            | 4.98    | 4.98   | 46       | 4,911   | 自動車部品                |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC              | 6.59    | 8.64   | 85       | 9,139   | 資本市場                 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC       | 15.11   | 16.26  | 93       | 9,909   | ソフトウェア               |
| DOLLAR GENERAL CORP                  | 17.88   | 19.32  | 335      | 35,672  | 複合小売り                |
| FORTINET INC                         | 8.46    | 11.42  | 154      | 16,412  | ソフトウェア               |
| AON PLC                              | 15.84   | —      | —        | —       | 保険                   |
| TESLA INC                            | 8.43    | 10.22  | 797      | 84,790  | 自動車                  |
| GENERAL MOTORS CO                    | 85.23   | 100.9  | 226      | 24,081  | 自動車                  |
| WORLDPAY INC                         | 20.31   | —      | —        | —       | 情報技術サービス             |
| XPO LOGISTICS INC                    | 7.48    | 7.48   | 49       | 5,265   | 航空貨物・物流サービス          |
| TRIPADVISOR INC                      | 6.25    | 6.25   | 11       | 1,244   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ALLY FINANCIAL INC                   | 30.96   | 25.51  | 38       | 4,091   | 消費者金融                |
| CAPRI HOLDINGS LTD                   | 8.79    | 16.82  | 23       | 2,509   | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| VOYA FINANCIAL INC                   | 9.49    | 9.78   | 42       | 4,551   | 各種金融サービス             |
| APTIV PLC                            | 18.6    | 18.59  | 121      | 12,897  | 自動車部品                |
| PHILLIPS 66                          | 29.98   | 33.31  | 244      | 25,972  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC               | —       | 6.56   | 62       | 6,677   | ソフトウェア               |
| FACEBOOK INC                         | 160.78  | 181.84 | 3,841    | 408,587 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| IQVIA HOLDINGS INC                   | 11.21   | 12.5   | 169      | 18,017  | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| DIAMONDBACK ENERGY INC               | 10.84   | 14.88  | 60       | 6,389   | 石油・ガス・消耗燃料           |
| SERVICENOW INC                       | 12.13   | 14.35  | 547      | 58,277  | ソフトウェア               |
| PALO ALTO NETWORKS INC               | 6.37    | 7.39   | 157      | 16,752  | ソフトウェア               |
| TABLEAU SOFTWARE INC                 | 4.76    | —      | —        | —       | ソフトウェア               |
| WORKDAY INC                          | 9.89    | 12.27  | 197      | 20,966  | ソフトウェア               |
| ABBVIE INC                           | 100.9   | 111.78 | 941      | 100,128 | バイオテクノロジー            |
| ZOETIS INC                           | 32.7    | 36.03  | 447      | 47,610  | 医薬品                  |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD   | 12.94   | 17.24  | 20       | 2,200   | ホテル・レストラン・レジャー       |
| COTY INC                             | 30.69   | 30.69  | 15       | 1,609   | パーソナル用品              |
| NEWS CORP/NEW-CL A                   | 22.51   | 39.47  | 38       | 4,051   | メディア                 |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC               | 10.26   | 14     | 40       | 4,337   | 商社・流通業               |
| CDW CORP                             | 10.8    | 11.6   | 123      | 13,160  | 電子装置・機器・部品           |
| SPRINT CORP                          | 50.51   | —      | —        | —       | 無線通信サービス             |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC          | 6.95    | 6.95   | 6        | 705     | 旅客航空輸送業              |
| HOWMET AEROSPACE INC                 | 25.63   | 28.62  | 33       | 3,613   | 航空宇宙・防衛              |
| TWILIO INC                           | —       | 8.72   | 149      | 15,849  | 情報技術サービス             |
| SNAP INC                             | —       | 67.16  | 121      | 12,964  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C         | 11.94   | 16.2   | 49       | 5,229   | 娯楽                   |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A             | 5.21    | 5.21   | 16       | 1,725   | メディア                 |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C             | 14.6    | 14.6   | 45       | 4,790   | メディア                 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C             | 12      | 18.75  | 16       | 1,717   | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| OKTA INC                             | —       | 7.23   | 123      | 13,095  | 情報技術サービス             |
| BLACK KNIGHT INC                     | —       | 11.05  | 80       | 8,552   | 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    | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                         |
| BAKER HUGHES CO                  | 29.5    | 48.23 | 67        | 7,191       | エネルギー設備・サービス            |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC         | 8.62    | 11.86 | 65        | 6,990       | 食品                      |
| ALTICE USA INC-A                 | 23.3    | 10.9  | 25        | 2,666       | メディア                    |
| TECHNIPFMC LTD                   | 25.24   | 41.58 | 31        | 3,347       | エネルギー設備・サービス            |
| BROADCOM INC                     | 27.47   | 30.07 | 805       | 85,633      | 半導体・半導体製造装置             |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A          | -       | 5.92  | 153       | 16,352      | ソフトウェア                  |
| MONGODDB INC                     | -       | 3.66  | 64        | 6,829       | 情報技術サービス                |
| BURLINGTON STORES INC            | 3.97    | 4.74  | 84        | 8,990       | 専門小売り                   |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC        | 6.74    | -     | -         | -           | 保険                      |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC         | 18.99   | 30.83 | 61        | 6,518       | 医薬品                     |
| VEEVA SYSTEMS INC                | 8.42    | 9.9   | 189       | 20,137      | ヘルスケア・テクノロジー            |
| TWITTER INC                      | 45.48   | 56    | 161       | 17,135      | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | 9.99    | 13.09 | 46        | 4,963       | 電気設備                    |
| EVERGY INC                       | 18.8    | 15.54 | 86        | 9,234       | 電力                      |
| PLAINS GP HOLDINGS LP            | 9.43    | -     | -         | -           | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC         | 12.19   | -     | -         | -           | 通信機器                    |
| ALLEGION PLC                     | 5.58    | 7.77  | 77        | 8,275       | 建設関連製品                  |
| STERIS PLC                       | -       | 6.89  | 99        | 10,542      | ヘルスケア機器・用品              |
| DOCUSIGN INC                     | -       | 7.66  | 90        | 9,589       | ソフトウェア                  |
| WIX.COM LTD                      | 2.56    | 3.49  | 52        | 5,564       | 情報技術サービス                |
| DROPBOX INC                      | -       | 14.55 | 31        | 3,387       | ソフトウェア                  |
| KKR & CO INC                     | 33.03   | 36.83 | 99        | 10,533      | 資本市場                    |
| PERRIGO CO PLC                   | 7.63    | 10.64 | 54        | 5,849       | 医薬品                     |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC    | 20.22   | 19.53 | 140       | 14,935      | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARAMARK                          | 14.49   | 17.08 | 40        | 4,319       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CIGNA CORP                       | 25.03   | 28.3  | 521       | 55,437      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DELL TECHNOLOGIES INC            | 9.82    | 14.78 | 61        | 6,563       | コンピュータ・周辺機器             |
| DOW INC                          | 51.25   | 56.62 | 185       | 19,782      | 化学                      |
| AMCOR PLC                        | -       | 120   | 103       | 10,989      | 容器・包装                   |
| PINTEREST INC                    | -       | 22.85 | 42        | 4,544       | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| XEROX HOLDINGS CORP              | -       | 13.47 | 23        | 2,482       | コンピュータ・周辺機器             |
| FOX CORP-A                       | 23.5    | 23.5  | 59        | 6,311       | メディア                    |
| FOX CORP-B                       | 9.5     | 17.55 | 43        | 4,668       | メディア                    |
| CARRIER GLOBAL CORP              | -       | 58.68 | 96        | 10,241      | 建設関連製品                  |
| OTIS WORLDWIDE CORP              | -       | 29.34 | 152       | 16,167      | 機械                      |
| UBER TECHNOLOGIES INC            | -       | 32.12 | 99        | 10,566      | 陸運・鉄道                   |
| CORTEVA INC                      | -       | 52.3  | 138       | 14,713      | 化学                      |
| BLACKSTONE GROUP INC             | -       | 49.92 | 263       | 28,028      | 資本市場                    |
| GRUBHUB INC                      | 5.33    | 9.32  | 41        | 4,449       | インターネット販売・通信販売          |
| INGERSOLL RAND INC               | -       | 27.56 | 76        | 8,113       | 機械                      |
| PAYCOM SOFTWARE INC              | -       | 4.08  | 109       | 11,665      | ソフトウェア                  |
| SABRE CORP                       | 16.17   | 27.51 | 18        | 1,954       | 情報技術サービス                |
| AON PLC                          | -       | 17.72 | 327       | 34,834      | 保険                      |
| PARSLEY ENERGY INC               | 15.37   | -     | -         | -           | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ARISTA NETWORKS INC              | 3.64    | 3.78  | 79        | 8,460       | 通信機器                    |
| IHS MARKIT LTD                   | 27.58   | 27.99 | 185       | 19,743      | 専門サービス                  |
| FNFG GROUP                       | 16.13   | 21.63 | 54        | 5,767       | 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 |                      |  |
| <b>(アメリカ)</b>                   | 百株         | 百株        | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                      |  |
| SYNCHRONY FINANCIAL             | 43.48      | 36.68     | 65        | 7,018       | 消費者金融                |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC    | 34.65      | 33.4      | 70        | 7,548       | 銀行                   |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD           | —          | 2.99      | 31        | 3,368       | ソフトウェア               |  |
| CDK GLOBAL INC                  | 7.2        | 10.19     | 40        | 4,303       | ソフトウェア               |  |
| WAYFAIR INC                     | 3.34       | 4.73      | 83        | 8,899       | インターネット販売・通信販売       |  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC       | 13.41      | 13.05     | 126       | 13,462      | 電子装置・機器・部品           |  |
| QORVO INC                       | 7.38       | 9.35      | 94        | 10,026      | 半導体・半導体製造装置          |  |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC         | 12.41      | —         | —         | —           | 各種電気通信サービス           |  |
| LIBERTY BROADBAND CORP—C W/I    | 6.29       | 8.65      | 109       | 11,650      | メディア                 |  |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD      | 12.74      | 21.97     | 41        | 4,449       | 化学                   |  |
| GODADDY INC                     | 10.22      | 13.99     | 102       | 10,868      | 情報技術サービス             |  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC            | 20.9       | 27.81     | 38        | 4,046       | 専門サービス               |  |
| TRANSUNION                      | 13.47      | 13.8      | 108       | 11,563      | 専門サービス               |  |
| SQUARE INC                      | 20.45      | 26.24     | 195       | 20,825      | 情報技術サービス             |  |
| DUPONT DE NEMOURS INC           | 153.76     | 51.8      | 231       | 24,660      | 化学                   |  |
| COCA—COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | 12.83      | 18.91     | 71        | 7,656       | 飲料                   |  |
| WESTROCK CO                     | 19.04      | 16.76     | 42        | 4,472       | 容器・包装                |  |
| KRAFT HEINZ CO                  | 40.49      | 51.14     | 147       | 15,681      | 食品                   |  |
| FORTIVE CORP                    | 20.92      | 23.44     | 135       | 14,442      | 機械                   |  |
| MATCH GROUP INC                 | —          | 4.57      | 37        | 4,016       | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| WASTE CONNECTIONS INC           | 18.16      | 20.85     | 191       | 20,388      | 商業サービス・用品            |  |
| ALPHABET INC—CL A               | 19.94      | 22.66     | 3,102     | 330,012     | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO   | 100.32     | 103.45    | 99        | 10,540      | コンピュータ・周辺機器          |  |
| PAYPAL HOLDINGS INC             | 75.07      | 84.31     | 1,233     | 131,181     | 情報技術サービス             |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC          | 14         | 29.28     | 51        | 5,437       | 各種金融サービス             |  |
| FIRST DATA CORP                 | 31.55      | —         | —         | —           | 情報技術サービス             |  |
| DXC TECHNOLOGY CO               | 19.24      | 22.01     | 38        | 4,056       | 情報技術サービス             |  |
| ZILLOW GROUP INC—C              | 7.28       | 7.28      | 35        | 3,760       | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| ALPHABET INC—CL C               | 20.94      | 23.34     | 3,203     | 340,730     | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| BEIGENE LTD ADR                 | 1.92       | 3.03      | 46        | 4,944       | バイオテクノロジー            |  |
| L3 TECHNOLOGIES INC             | 5.48       | —         | —         | —           | 航空宇宙・防衛              |  |
| CHEMOURS CO                     | 10.96      | —         | —         | —           | 化学                   |  |
| LINDE PLC                       | 36.63      | 40.51     | 748       | 79,619      | 化学                   |  |
| ATHENE HOLDING LTD              | 9.17       | 13.98     | 34        | 3,696       | 保険                   |  |
| ROKU INC                        | —          | 7.71      | 106       | 11,275      | 娯楽                   |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC      | 10.99      | 11.42     | 587       | 62,462      | メディア                 |  |
| VISTRA ENERGY CORP              | 19.87      | 29.54     | 53        | 5,639       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者   |  |
| 小 計                             | 株 数 ・ 金 額  | 20,115.05 | 22,693.42 | 185,653     | 19,746,097           |  |
|                                 | 銘柄数 < 比率 > | 597銘柄     | 608銘柄     | —           | <66.7%>              |  |
| <b>(カナダ)</b>                    | 百株         | 百株        | 千カナダ・ドル   | 千円          |                      |  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD          | 13.89      | 18.29     | 167       | 12,801      | 金属・鉱業                |  |
| ALIMENTATION COUCHE TARD INC    | 29.76      | 61.46     | 245       | 18,741      | 食品・生活必需品小売り          |  |
| BARRICK GOLD CORP               | 126.55     | 137.93    | 526       | 40,154      | 金属・鉱業                |  |
| ATCO LTD                        | 4.68       | 4.68      | 17        | 1,338       | 総合公益事業               |  |
| BANK OF MONTREAL                | 42.12      | 48.85     | 327       | 25,013      | 銀行                   |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA             | 82.2       | 93.98     | 492       | 37,579      | 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     |                      |
| NATIONAL BANK OF CANADA                    | 25.58   | 27.02  | 147     | 11,257 | 銀行                   |
| BCE INC                                    | 9.44    | 11.36  | 64      | 4,901  | 各種電気通信サービス           |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT                | 57.73   | 100.58 | 466     | 35,628 | 資本市場                 |
| BAUSCH HEALTH COS INC                      | 18.58   | 20.58  | 45      | 3,483  | 医薬品                  |
| SAPUTO INC                                 | 13.86   | 20.87  | 71      | 5,446  | 食品                   |
| BLACKBERRY LTD                             | 31.84   | 31.84  | 20      | 1,562  | ソフトウェア               |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO             | —       | 41.06  | 78      | 5,990  | 総合公益事業               |
| CGI INC                                    | 18.55   | 19.17  | 174     | 13,316 | 情報技術サービス             |
| CCL INDUSTRIES INC                         | 8.86    | 15.57  | 68      | 5,206  | 容器・包装                |
| CAE INC                                    | 16.03   | 18.4   | 39      | 3,023  | 航空宇宙・防衛              |
| CAMECO CORP                                | 24.59   | 24.59  | 36      | 2,784  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| ROGERS COMM—CL B                           | 25.59   | 29.1   | 164     | 12,586 | 無線通信サービス             |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE                | 29.42   | 34.16  | 279     | 21,333 | 銀行                   |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES                 | 83.97   | 90.22  | 194     | 14,870 | 石油・ガス・消耗燃料           |
| CANADIAN TIRE CORP—CL A                    | 3.64    | 3.48   | 32      | 2,461  | 複合小売り                |
| CANADIAN UTILITIES LTD                     | 7.89    | 16.3   | 52      | 3,987  | 総合公益事業               |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO                   | 49.35   | 54.27  | 613     | 46,788 | 陸運・鉄道                |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 12.27   | —      | —       | —      | エクイティ不動産投資信託 (REITs) |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                      | 12.35   | 20.82  | 38      | 2,964  | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| OPEN TEXT CORP                             | 20.38   | 18.63  | 101     | 7,773  | ソフトウェア               |
| EMPIRE CO LTD                              | 10.76   | 10.76  | 32      | 2,460  | 食品・生活必需品小売り          |
| KINROSS GOLD CORP                          | 79.63   | 107.67 | 106     | 8,158  | 金属・鉱業                |
| FINNING INTERNATIONAL INC                  | 10.76   | —      | —       | —      | 商社・流通業               |
| FORTIS INC                                 | 30.74   | 36.07  | 190     | 14,574 | 電力                   |
| TELUS CORP                                 | 6       | 12     | 27      | 2,083  | 各種電気通信サービス           |
| GREAT WEST LIFECO INC                      | 17.87   | 25.41  | 53      | 4,085  | 保険                   |
| IMPERIAL OIL LTD                           | 16.69   | 22.28  | 46      | 3,538  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| ENBRIDGE INC                               | 135.64  | 153.4  | 684     | 52,231 | 石油・ガス・消耗燃料           |
| IGM FINANCIAL INC                          | 5.36    | 5.36   | 14      | 1,132  | 資本市場                 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD               | 65.9    | —      | —       | —      | 金属・鉱業                |
| MANULIFE FINANCIAL CORP                    | 138.12  | 149.86 | 245     | 18,754 | 保険                   |
| LOBLAW CO LTD                              | 11.13   | 15.98  | 107     | 8,220  | 食品・生活必需品小売り          |
| MAGNA INTERNATIONAL INC                    | 23.5    | 20.57  | 109     | 8,391  | 自動車部品                |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                     | 42.21   | 45.36  | 216     | 16,542 | 保険                   |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD                | 2       | 2.11   | 73      | 5,622  | 保険                   |
| METRO INC                                  | 18.92   | 19.98  | 115     | 8,811  | 食品・生活必需品小売り          |
| HUSKY ENERGY INC                           | 22.14   | 22.14  | 8       | 667    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| EMERA INC                                  | 3.65    | 20.84  | 113     | 8,667  | 電力                   |
| METHANEX CORP                              | 4.01    | 4.01   | 8       | 663    | 化学                   |
| ONEX CORP                                  | 5.21    | 5.11   | 33      | 2,520  | 各種金融サービス             |
| POWER CORP OF CANADA                       | 30.05   | 41.52  | 84      | 6,479  | 保険                   |
| POWER FINANCIAL CORP                       | 15.14   | —      | —       | —      | 保険                   |
| QUEBECOR INC—B                             | —       | 11.53  | 34      | 2,630  | メディア                 |
| ROYAL BANK OF CANADA                       | 95.41   | 108.86 | 916     | 69,929 | 銀行                   |
| SNC—LAVALIN GROUP INC                      | 10.46   | —      | —       | —      | 建設・土木                |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD               | 9.92    | 10.44  | 327     | 25,019 | 陸運・鉄道                |

| 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 |                         |  |
| <b>(カナダ)</b>                        | 百株         | 百株       | 千カナダ・ドル     | 千円     |                         |  |
| SHAW COMM INC-B                     | 35.85      | 36.02    | 81          | 6,209  | メディア                    |  |
| SUNCOR ENERGY INC                   | 111.37     | 116.85   | 270         | 20,660 | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| LUNDIN MINING CORP                  | 44.52      | 44.52    | 28          | 2,167  | 金属・鉱業                   |  |
| ENCANA CORP                         | 105.05     | -        | -           | -      | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| TECK RESOURCES LTD-CL B             | 30.6       | 41.11    | 50          | 3,817  | 金属・鉱業                   |  |
| THOMSON REUTERS CORP                | 12.24      | 15.48    | 148         | 11,308 | 専門サービス                  |  |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$     | 121.15     | 137.23   | 771         | 58,905 | 銀行                      |  |
| TC ENERGY CORP                      | 62.42      | 70.94    | 455         | 34,743 | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD           | 3.75       | 3.75     | 13          | 1,057  | 紙製品・林産品                 |  |
| WESTON (GEORGE) LTD                 | 7.38       | 4.93     | 47          | 3,633  | 食品・生活必需品小売り             |  |
| INTACT FINANCIAL CORP               | 10.56      | 10.93    | 148         | 11,308 | 保険                      |  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP        | 26.57      | 30.61    | 187         | 14,295 | 金属・鉱業                   |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC          | 1.44       | 1.4      | 196         | 14,982 | ソフトウェア                  |  |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR              | 13.92      | 14.66    | 296         | 22,620 | 金属・鉱業                   |  |
| CI FINANCIAL CORP                   | 15.99      | 15.99    | 22          | 1,718  | 資本市場                    |  |
| TOURMALINE OIL CORP                 | 16.33      | -        | -           | -      | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| KEYERA CORP                         | 12.34      | 24.18    | 49          | 3,789  | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| PARKLAND FUEL CORP                  | -          | 11.68    | 37          | 2,852  | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| ALTAGAS LTD                         | 16.77      | 16.77    | 27          | 2,073  | ガス                      |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP               | 36.44      | 39.28    | 122         | 9,364  | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| DOLLARAMA INC                       | 18.38      | 19.91    | 86          | 6,634  | 複合小売り                   |  |
| STARS GROUP INC                     | 10.53      | 12.14    | 45          | 3,473  | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| CENOVUS ENERGY INC W/I              | 61.71      | 80.04    | 42          | 3,267  | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| VERMILION ENERGY INC                | 9.12       | -        | -           | -      | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| ARC RESOURCES LTD                   | 22.28      | -        | -           | -      | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD              | -          | 18.99    | 114         | 8,761  | 金属・鉱業                   |  |
| INTER PIPELINE LTD                  | 23         | 41.96    | 44          | 3,390  | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| NUTRIEN LTD                         | 41.68      | 44.42    | 214         | 16,331 | 化学                      |  |
| WSP GLOBAL INC                      | 6.23       | 6.94     | 62          | 4,744  | 建設・土木                   |  |
| IA FINANCIAL CORP INC               | 6.6        | 7.53     | 31          | 2,408  | 保険                      |  |
| NEWMONT GOLDCORP CORP               | 16.96      | -        | -           | -      | 金属・鉱業                   |  |
| OVINTIV INC                         | -          | 21.01    | 15          | 1,189  | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD              | 13.35      | 13.35    | 12          | 975    | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD        | 17.05      | -        | -           | -      | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| AIR CANADA                          | -          | 8.74     | 14          | 1,102  | 旅客航空輸送業                 |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 17.7       | 22.68    | 160         | 12,217 | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| AURORA CANNABIS INC                 | 39.28      | 39.28    | 3           | 287    | 医薬品                     |  |
| SHOPIFY INC                         | 6.22       | 7.84     | 796         | 60,802 | 情報技術サービス                |  |
| CANOPY GROWTH CORP                  | 11.91      | 16.53    | 35          | 2,722  | 医薬品                     |  |
| HYDRO ONE LTD                       | 19.82      | 21.86    | 55          | 4,243  | 電力                      |  |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額  | 2,606.85 | 2,834.02    | 12,714 | 970,242                 |  |
|                                     | 銘柄数 < 比率 > | 86銘柄     | 81銘柄        | -      | <3.3%>                  |  |
| <b>(オーストラリア)</b>                    | 百株         | 百株       | 千オーストラリア・ドル | 千円     |                         |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD              | 8.21       | 13.67    | 84          | 5,883  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LT        | 187.73     | 221.74   | 351         | 24,398 | 銀行                      |  |
| WESTPAC BANKING CORPORATION         | 222.98     | 278.49   | 434         | 30,159 | 銀行                      |  |
| BANK OF QUEENSLAND LTD              | 24.71      | -        | -           | -      | 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 |                         |
| (オーストラリア)                            | 百株      | 百株     | 千オーストラリア・ドル | 千円          |                         |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           | 96.05   | 114.11 | 130         | 9,070       | 金属・鉱業                   |
| TELSTRA CORP LTD                     | 245.06  | 334.91 | 102         | 7,114       | 各種電気通信サービス              |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD        | 29.95   | 29.95  | 17          | 1,230       | 銀行                      |
| AMP LTD                              | 180.37  | 382.38 | 52          | 3,623       | 各種金融サービス                |
| ASX LTD                              | 11.88   | 13.13  | 106         | 7,381       | 資本市場                    |
| BHP GROUP LTD                        | 198.54  | 221.98 | 688         | 47,770      | 金属・鉱業                   |
| CALTEX AUSTRALIA LTD                 | 15.82   | 15.82  | 38          | 2,673       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD           | 36.4    | 36.4   | 10          | 717         | 複合小売り                   |
| COMPUTERSHARE LT                     | 28.29   | 46.52  | 53          | 3,687       | 情報技術サービス                |
| CSL LIMITED                          | 30.38   | 34.42  | 1,059       | 73,577      | バイオテクノロジー               |
| REA GROUP LTD                        | 3.22    | 3.22   | 28          | 1,974       | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TRANSURBAN GROUP                     | 178.27  | 210.39 | 282         | 19,600      | 運送インフラ                  |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 | 30.91   | 30.91  | 25          | 1,804       | 飲料                      |
| COCHLEAR LTD                         | 4.54    | 4.54   | 83          | 5,814       | ヘルスケア機器・用品              |
| ORIGIN ENERGY LTD                    | 102.93  | 144.83 | 80          | 5,559       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA       | 116     | 135.2  | 801         | 55,618      | 銀行                      |
| BORAL LIMITED                        | 71.24   | 93.78  | 25          | 1,783       | 建設資材                    |
| RIO TINTO LIMITED                    | 26.64   | 30.34  | 247         | 17,167      | 金属・鉱業                   |
| APA GROUP                            | 91.87   | 91.87  | 102         | 7,085       | ガス                      |
| ARISTOCRAT LEISU                     | 42.72   | 47.39  | 118         | 8,224       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT         | 137.49  | 159.96 | 84          | 5,885       | 保険                      |
| TPG TELECOM LTD                      | 22.43   | 22.43  | 16          | 1,121       | 各種電気通信サービス              |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD       | 3.34    | 3.34   | 3           | 230         | ホテル・レストラン・レジャー          |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC          | 26.87   | 25.11  | 53          | 3,744       | 建設資材                    |
| ORICA LTD                            | 22.09   | 40.78  | 68          | 4,744       | 化学                      |
| CIMIC GROUP LTD                      | 5.69    | 5.69   | 13          | 916         | 建設・土木                   |
| LEND LEASE CORP LTD                  | 34.9    | 31.95  | 36          | 2,506       | 不動産管理・開発                |
| BLUESCOPE STEEL LTD                  | 33.79   | 33.79  | 34          | 2,362       | 金属・鉱業                   |
| SYDNEY AIRPORT                       | 67.82   | 53.43  | 28          | 2,010       | 運送インフラ                  |
| MACQUARIE GROUP LTD                  | 22.11   | 25.92  | 258         | 17,912      | 資本市場                    |
| WORLEY LTD                           | 18.65   | 18.65  | 15          | 1,096       | エネルギー設備・サービス            |
| SUNCORP GROUP LTD                    | 94.23   | 102.24 | 89          | 6,224       | 保険                      |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD          | 177.71  | 226.03 | 366         | 25,450      | 銀行                      |
| NEWCREST MINING LTD                  | 56.97   | 61.47  | 171         | 11,875      | 金属・鉱業                   |
| OIL SEARCH LTD                       | 79.28   | 144.93 | 41          | 2,887       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INCITEC PIVOT LTD                    | 98.5    | 98.5   | 21          | 1,504       | 化学                      |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED               | -       | 51.76  | 17          | 1,243       | 旅客航空輸送業                 |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED          | 98.26   | 94.38  | 70          | 4,920       | 保険                      |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICES        | 33.59   | 33.59  | 15          | 1,058       | 各種金融サービス                |
| SANTOS LTD                           | 102.94  | 136.01 | 64          | 4,494       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SONIC HEALTHCARE                     | 28.65   | 29.63  | 76          | 5,319       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD | 6.17    | 6.17   | 11          | 764         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TABCORP HOLDINGS LTD                 | 111.7   | 219.33 | 68          | 4,780       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESFARMERS LTD                       | 79.01   | 84.26  | 306         | 21,291      | 複合小売り                   |
| ALUMINA LIMITED                      | 157.75  | 187.72 | 29          | 2,058       | 金属・鉱業                   |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD               | 63.54   | 71.11  | 153         | 10,687      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WOOLWORTHS GROUP LTD                 | 90.17   | 95.18  | 332         | 23,066      | 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 |                      |  |
| <b>(オーストラリア)</b>                   | 百株         | 百株       | 千オーストラリア・ドル | 千円     |                      |  |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD       | —          | 7.78     | 41          | 2,864  | 資本市場                 |  |
| SEEK LTD                           | 19.33      | 20.25    | 34          | 2,379  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD     | 3.66       | —        | —           | —      | ホテル・レストラン・レジャー       |  |
| AUSNET SERVICES                    | 112.62     | 112.62   | 21          | 1,524  | 電力                   |  |
| AGL ENERGY LTD                     | 48.62      | 43.74    | 71          | 4,976  | 総合公益事業               |  |
| BRAMBLES LTD                       | 113.77     | 129.04   | 137         | 9,540  | 商業サービス・用品            |  |
| CROWN RESORTS LTD                  | 22.84      | 22.84    | 20          | 1,452  | ホテル・レストラン・レジャー       |  |
| AURIZON HOLDINGS LTD               | 164.72     | 151.06   | 69          | 4,802  | 陸運・鉄道                |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD          | 42.1       | 60.65    | 60          | 4,172  | 飲料                   |  |
| AMCOR PLC—CDI                      | 84.58      | —        | —           | —      | 容器・包装                |  |
| MEDIBANK PVT LTD                   | 159.8      | 223.04   | 63          | 4,412  | 保険                   |  |
| SOUTH32 LTD(AUD)                   | 370.94     | 407.69   | 76          | 5,278  | 金属・鉱業                |  |
| COLES GROUP LTD                    | 66.48      | 90.9     | 138         | 9,610  | 食品・生活必需品小売り          |  |
| WISETECH GLOBAL LTD                | —          | 12.19    | 24          | 1,697  | ソフトウェア               |  |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額  | 4,867.82 | 5,881.15    | 8,135  | 564,795              |  |
|                                    | 銘柄数 < 比率 > | 62銘柄     | 62銘柄        | —      | <1.9%>               |  |
| <b>(香港)</b>                        | 百株         | 百株       | 千香港・ドル      | 千円     |                      |  |
| ASM PACIFIC TECH                   | 18         | 18       | 145         | 1,997  | 半導体・半導体製造装置          |  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD           | 120        | 110      | 177         | 2,432  | 不動産管理・開発             |  |
| BANK OF EAST ASIA                  | 76.57      | 66.57    | 105         | 1,448  | 銀行                   |  |
| CLP HOLDINGS LTD                   | 112.96     | 122.96   | 983         | 13,487 | 電力                   |  |
| PCCW LTD                           | 250        | 250      | 118         | 1,629  | 各種電気通信サービス           |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD     | 38.14      | 38.14    | 172         | 2,370  | 電力                   |  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR        | 78.51      | 92.51    | 2,279       | 31,274 | 資本市場                 |  |
| MTR CORP                           | 89.41      | 124.41   | 533         | 7,314  | 陸運・鉄道                |  |
| HANG LUNG GROUP LTD                | 50         | —        | —           | —      | 不動産管理・開発             |  |
| HANG SENG BANK LTD                 | 46.96      | 56.96    | 763         | 10,471 | 銀行                   |  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT         | 104.75     | 115.22   | 348         | 4,781  | 不動産管理・開発             |  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD          | 83.2       | 98.2     | 491         | 6,749  | 電力                   |  |
| (THE) WHARF HOLDINGS LTD           | 73.85      | —        | —           | —      | 不動産管理・開発             |  |
| HONG KONG & CHINA GAS              | 629.84     | 762.82   | 1,046       | 14,359 | ガス                   |  |
| HYSAN DEVELOPMENT CO               | 40         | —        | —           | —      | 不動産管理・開発             |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD     | 169.04     | 149.04   | 761         | 10,449 | ホテル・レストラン・レジャー       |  |
| KERRY PROPERTIES LTD               | 35         | 35       | 74          | 1,020  | 不動産管理・開発             |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         | 259.95     | 274.95   | 658         | 9,034  | 銀行                   |  |
| NWS HOLDINGS LTD                   | 90         | 90       | 69          | 949    | コングロマリット             |  |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS       | 45         | 45       | 57          | 782    | 繊維・アパレル・贅沢品          |  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT              | 480        | 520      | 470         | 6,449  | 不動産管理・開発             |  |
| SHANGRI—LA ASIA LTD                | 80         | —        | —           | —      | ホテル・レストラン・レジャー       |  |
| SINO LAND CO                       | 198        | 298      | 318         | 4,374  | 不動産管理・開発             |  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES            | 110.65     | 115.65   | 1,185       | 16,263 | 不動産管理・開発             |  |
| SWIRE PACIFIC LTD A                | 35.2       | 35.2     | 171         | 2,349  | 不動産管理・開発             |  |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO           | 81.56      | 111.56   | 713         | 9,788  | 機械                   |  |
| VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | —          | 40       | 115         | 1,586  | 食品                   |  |
| WHEELOCK & CO LTD                  | 51.44      | 81.44    | 463         | 6,363  | 不動産管理・開発             |  |
| MINTH GROUP LTD                    | 40         | —        | —           | —      | 自動車部品                |  |
| SJM HOLDINGS LTD                   | 120        | 120      | 92          | 1,266  | 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 |                         |  |
| <b>(香港)</b>   | 百株         | 百株       | 千香港・ドル       | 千円     |                         |  |
| WYNN MACAU LTD  | 95.53      | 95.53    | 128          | 1,766  | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD                                | 58         | —        | —            | —      | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| AIA GROUP LTD   | 808.89     | 918.89   | 6,358        | 87,241 | 保険                      |  |
| HKT TRUST / HKT LTD                                   | —          | 341.36   | 428          | 5,882  | 各種電気通信サービス              |  |
| SANDS CHINA LTD                                       | 182        | 202      | 620          | 8,508  | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD                                  | 68         | 102      | 216          | 2,966  | 不動産管理・開発                |  |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD                   | 73.85      | 93.85    | 309          | 4,249  | 不動産管理・開発                |  |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD | 165        | 165      | 132          | 1,811  | 電力                      |  |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LTD                         | —          | 107      | 226          | 3,112  | 飲料                      |  |
| WH GROUP LTD  | 515        | 780      | 558          | 7,662  | 食品                      |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD                             | 186.13     | 211.13   | 1,181        | 16,207 | コングロマリット                |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD                                 | 183.63     | 213.63   | 1,028        | 14,112 | 不動産管理・開発                |  |
| 小 計   | 株 数 ・ 金 額  | 5,944.06 | 7,002.02     | 23,507 | 322,516                 |  |
|   | 銘柄数 < 比率 > | 39銘柄     | 36銘柄         | —      | <1.1%>                  |  |
| <b>(シンガポール)</b>                                       | 百株         | 百株       | 千シンガポール・ドル   | 千円     |                         |  |
| SINGAPORE TECH ENG                                    | 92         | 110      | 36           | 2,735  | 航空宇宙・防衛                 |  |
| SEMBCORP INDUSTRIES                                   | 62.34      | 62.34    | 9            | 742    | コングロマリット                |  |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD                          | 101        | 101      | 16           | 1,217  | メディア                    |  |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD                             | 410.29     | —        | —            | —      | 食品                      |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD                                | 117.1      | 135.1    | 266          | 20,097 | 銀行                      |  |
| CITY DEVELOPMENTS LTD                                 | 25         | 50       | 39           | 2,965  | 不動産管理・開発                |  |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD                          | 6.04       | 6.04     | 12           | 916    | 販売                      |  |
| SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD               | 42         | 42       | 12           | 946    | 運送インフラ                  |  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD                                | 79         | 79       | 77           | 5,810  | 資本市場                    |  |
| CAPITALAND LTD  | 152.75     | 209.75   | 60           | 4,583  | 不動産管理・開発                |  |
| GENTING SINGAPORE LTD                                 | 369.93     | 369.93   | 28           | 2,132  | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| KEPPEL CORP LTD                                       | 86         | 85       | 51           | 3,843  | コングロマリット                |  |
| COMFORTDELGRO CORP LTD                                | 133.18     | 133.18   | 21           | 1,595  | 陸運・鉄道                   |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP                          | 207.45     | 247.45   | 219          | 16,559 | 銀行                      |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS                          | 556.08     | 662.08   | 182          | 13,720 | 各種電気通信サービス              |  |
| SINGAPORE AIRLINES LTD                                | 35         | 71       | 31           | 2,354  | 旅客航空輸送業                 |  |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD                              | 88.66      | 102.66   | 204          | 15,380 | 銀行                      |  |
| UOL GROUP LIMITED                                     | 31         | 31       | 20           | 1,581  | 不動産管理・開発                |  |
| VENTURE CORP LTD                                      | 17         | 17       | 26           | 2,019  | 電子装置・機器・部品              |  |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD                              | 118        | 105      | 36           | 2,753  | 食品                      |  |
| YANGZUJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD                 | 144        | 144      | 14           | 1,058  | 機械                      |  |
| 小 計   | 株 数 ・ 金 額  | 2,873.82 | 2,763.53     | 1,366  | 103,014                 |  |
|   | 銘柄数 < 比率 > | 21銘柄     | 20銘柄         | —      | <0.3%>                  |  |
| <b>(ニュージーランド)</b>                                     | 百株         | 百株       | 千ニュージーランド・ドル | 千円     |                         |  |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                             | 55.5       | 95.73    | 54           | 3,547  | 運送インフラ                  |  |
| RYMAN HEALTHCARE LTD                                  | 23.19      | 23.19    | 28           | 1,836  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| A2 MILK CO LTD  | 45.03      | 48.05    | 94           | 6,166  | 食品                      |  |
| FISHER & PAYKEL                                       | 33.35      | 52.97    | 155          | 10,120 | ヘルスケア機器・用品              |  |
| FLETCHER BUILDING LTD                                 | 53.5       | 53.5     | 18           | 1,217  | 建設資材                    |  |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                                 | 108.16     | 112.28   | 50           | 3,277  | 各種電気通信サービス              |  |
| MIGHTY RIVER POWER LTD                                | —          | 83.4     | 38           | 2,515  | 電力                      |  |

| 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 |                    |  |
| (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          |                    |  |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | 79.95      | 79.95    | 36           | 2,390       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額  | 398.68   | 549.07       | 477         | 31,071             |  |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 7銘柄      | 8銘柄          | -           | <0.1%>             |  |
| (イギリス)                       | 百株         | 百株       | 千イギリス・ポンド    | 千円          |                    |  |
| ANTOFAGASTA PLC              | 25.87      | 48.64    | 39           | 5,163       | 金属・鉱業              |  |
| ASHTAD GROUP                 | 36.3       | 31.83    | 70           | 9,292       | 商社・流通業             |  |
| SEVERN TRENT PLC             | 13.92      | 14.5     | 35           | 4,617       | 水道                 |  |
| BHP GROUP PLC                | 145.09     | 156.5    | 215          | 28,381      | 金属・鉱業              |  |
| BARCLAYS PLC                 | 1,136.28   | 1,322.8  | 139          | 18,367      | 銀行                 |  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 59.21      | 68.97    | 36           | 4,822       | 家庭用耐久財             |  |
| BT GROUP PLC                 | 563.31     | 636.47   | 66           | 8,795       | 各種電気通信サービス         |  |
| BUNZL PLC                    | 24.72      | 26.23    | 45           | 5,979       | 商社・流通業             |  |
| EASYJET PLC                  | 10.34      | 10.34    | 5            | 723         | 旅客航空輸送業            |  |
| AVIVA PLC                    | 271.52     | 299.05   | 73           | 9,742       | 保険                 |  |
| CRODA INTERNATIONAL          | 7.53       | 10.95    | 54           | 7,163       | 化学                 |  |
| DIAGEO PLC                   | 164.01     | 178.02   | 494          | 65,150      | 飲料                 |  |
| SCHRODERS PLC                | 7.43       | 7.22     | 20           | 2,654       | 資本市場               |  |
| DCC PLC                      | 7.77       | 7.77     | 45           | 5,965       | コンプロマリット           |  |
| NATIONAL GRID PLC            | 224.7      | 267.11   | 246          | 32,416      | 総合公益事業             |  |
| KINGFISHER PLC               | 124.65     | 218.91   | 34           | 4,501       | 専門小売り              |  |
| BAE SYSTEMS PLC              | 218.96     | 247.96   | 127          | 16,731      | 航空宇宙・防衛            |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 153.49     | 174.05   | 518          | 68,260      | タバコ                |  |
| HALMA PLC                    | -          | 31.4     | 70           | 9,237       | 電子装置・機器・部品         |  |
| NEXT PLC                     | 8.2        | 10.93    | 53           | 7,029       | 複合小売り              |  |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 63.91      | 70.23    | 114          | 15,053      | タバコ                |  |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 11.37      | 16.74    | 32           | 4,311       | 化学                 |  |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 72.66      | 74.11    | 108          | 14,322      | 金属・鉱業              |  |
| COMPASS GROUP PLC            | 105.78     | 118.87   | 152          | 20,154      | ホテル・レストラン・レジャー     |  |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 1,313.12   | 1,537.42 | 634          | 83,588      | 銀行                 |  |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 412.61     | 431.78   | 88           | 11,660      | 保険                 |  |
| CENTRICA PLC                 | 331.97     | 465.58   | 18           | 2,447       | 総合公益事業             |  |
| UNILEVER PLC                 | 75.3       | 84.33    | 344          | 45,360      | パーソナル用品            |  |
| MEGGITT PLC                  | 47.75      | 78.73    | 20           | 2,672       | 航空宇宙・防衛            |  |
| MORRISON <W.M.> SUPERMARKETS | 130.82     | 239.87   | 44           | 5,912       | 食品・生活必需品小売り        |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 40.05      | 44.1     | 39           | 5,226       | 水道                 |  |
| RSA INSURANCE GROUP PLC GRP  | 59.75      | 51.28    | 20           | 2,659       | 保険                 |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 20.88      | 28.42    | 50           | 6,611       | 食品                 |  |
| PEARSON PLC                  | 45.89      | 60.87    | 27           | 3,605       | メディア               |  |
| PERSIMMON PLC                | 23.95      | 23.95    | 54           | 7,200       | 家庭用耐久財             |  |
| PRUDENTIAL PLC               | 174.06     | 197.55   | 221          | 29,226      | 保険                 |  |
| RIO TINTO PLC                | 79.27      | 84.9     | 316          | 41,668      | 金属・鉱業              |  |
| VODAFONE GROUP PLC           | 1,800.97   | 2,034.07 | 229          | 30,253      | 無線通信サービス           |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 43.97      | 53.76    | 357          | 47,083      | 家庭用品               |  |
| RELX PLC                     | 132.72     | 147.11   | 273          | 36,027      | 専門サービス             |  |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | -          | 128.92   | 62           | 8,187       | 商業サービス・用品          |  |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC     | 114.13     | 124.66   | 35           | 4,714       | 航空宇宙・防衛            |  |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 283.33     | 351.49   | 40           | 5,283       | 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 |                         |
| (イギリス)                          | 百株       | 百株       | 千イギリス・ポンド | 千円          |                         |
| ST JAMES'S PLACE PLC            | 32.22    | 33.04    | 28        | 3,696       | 資本市場                    |
| SSE PLC                         | 71.32    | 68.19    | 84        | 11,098      | 電力                      |
| BP PLC                          | 1,328.74 | 1,533.11 | 484       | 63,802      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SAGE GROUP PLC(THE)             | 63.44    | 87.22    | 55        | 7,376       | ソフトウェア                  |
| SMITHS GROUP PLC                | 23.2     | 31.58    | 39        | 5,200       | コンピュータリット               |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC    | -        | 4.72     | 44        | 5,826       | 機械                      |
| STANDARD CHARTERED PLC          | 191.94   | 213.93   | 88        | 11,650      | 銀行                      |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 4,650.19 | 5,369.3  | 167       | 22,069      | 銀行                      |
| TAYLOR WIMPLEY PLC              | 267.59   | 267.59   | 40        | 5,354       | 家庭用耐久財                  |
| TESCO PLC                       | 662.57   | 758.3    | 179       | 23,705      | 食品・生活必需品小売り             |
| 3I GROUP PLC                    | 71.69    | 69.03    | 52        | 6,956       | 資本市場                    |
| SMITH & NEPHEW PLC              | 61.86    | 67.29    | 111       | 14,693      | ヘルスケア機器・用品              |
| GLAXOSMITHKLINE PLC             | 330.34   | 378.06   | 633       | 83,404      | 医薬品                     |
| WEIR GROUP                      | 14.81    | 27.94    | 26        | 3,543       | 機械                      |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC       | 21.65    | 23.91    | 187       | 24,657      | 資本市場                    |
| BABCOCK INT'L GROUP             | 15.85    | -        | -         | -           | 商業サービス・用品               |
| WPP PLC                         | 88.34    | 96.75    | 58        | 7,711       | メディア                    |
| ASTRAZENECA PLC                 | 84.3     | 99.19    | 848       | 111,842     | 医薬品                     |
| WHITBREAD PLC                   | 10.78    | 11.85    | 33        | 4,461       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CARNIVAL PLC                    | 10.17    | 15.94    | 14        | 1,967       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC       | 94.6     | 175.65   | 16        | 2,200       | 複合小売り                   |
| JOHN WOOD GROUP PLC             | 41.58    | -        | -         | -           | エネルギー設備・サービス            |
| INTERTEK GROUP PLC              | 12.34    | 13.01    | 61        | 8,093       | 専門サービス                  |
| BURBERRY GROUP PLC              | 24.34    | 23.4     | 32        | 4,269       | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| INVESTEC PLC                    | 42.12    | -        | -         | -           | 資本市場                    |
| INTERCONTINENTAL HOTELS         | 10.75    | 14.2     | 51        | 6,723       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ITV PLC                         | 212.41   | 120.27   | 8         | 1,161       | メディア                    |
| SAINSBURY (J) PLC               | 102.78   | 93.03    | 17        | 2,361       | 食品・生活必需品小売り             |
| G4S PLC                         | 97.12    | 97.12    | 9         | 1,239       | 商業サービス・用品               |
| ADMIRAL GROUP PLC               | 12.38    | 12.38    | 29        | 3,938       | 保険                      |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS     | 7.29     | 8.68     | 37        | 4,880       | 家庭用耐久財                  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 303.89   | 322.26   | 425       | 56,065      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     | 250.1    | 276.12   | 348       | 45,964      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TUI AG-DI                       | 25.76    | 47.89    | 12        | 1,671       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AVEVA GROUP PLC                 | -        | 5.23     | 20        | 2,693       | ソフトウェア                  |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC      | 137.15   | 201.29   | 44        | 5,820       | 資本市場                    |
| EXPERIAN PLC                    | 63.91    | 68.47    | 178       | 23,461      | 専門サービス                  |
| MONDI PLC                       | 28.4     | 38.53    | 52        | 6,908       | 紙製品・林産品                 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 16.83    | 28.35    | 42        | 5,620       | 資本市場                    |
| FRESNILLO PLC NPR               | 13.63    | -        | -         | -           | 金属・鉱業                   |
| OCADO GROUP PLC                 | -        | 33.03    | 61        | 8,110       | インターネット販売・通信販売          |
| INFORMA PLC                     | 93.13    | 82.67    | 37        | 4,947       | メディア                    |
| GLENCORE PLC                    | 781.01   | 791.11   | 117       | 15,435      | 金属・鉱業                   |
| GVC HOLDINGS PLC                | 33.83    | 60.15    | 47        | 6,282       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| EVRAZ PLC                       | -        | 30.46    | 8         | 1,083       | 金属・鉱業                   |
| NMC HEALTH PLC                  | 6.5      | -        | -         | -           | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | 79.12    | 71.57    | 20        | 2,645       | 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  |                      |  |
| <b>(イギリス)</b>                            | 百株         | 百株        | 千イギリス・ポンド   | 千円      |                      |  |
| COCA-COLA HBC AG                         | 11.89      | 19.57     | 37          | 4,889   | 飲料                   |  |
| CONVATEC GROUP PLC                       | 86.41      | -         | -           | -       | ヘルスケア機器・用品           |  |
| ROYAL MAIL PLC                           | 56.04      | -         | -           | -       | 航空貨物・物流サービス          |  |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC                | 45.01      | -         | -           | -       | ホテル・レストラン・レジャー       |  |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C               | 8,103.23   | -         | -           | -       | 航空宇宙・防衛              |  |
| FERGUSON PLC                             | 16.86      | 14.92     | 85          | 11,203  | 商社・流通業               |  |
| M&G PLC                                  | -          | 234.53    | 30          | 4,066   | 各種金融サービス             |  |
| JD SPORTS FASHION PLC                    | -          | 33.38     | 18          | 2,437   | 専門小売り                |  |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC            | 25.61      | 21.24     | 10          | 1,334   | ソフトウェア               |  |
| AUTO TRADER GROUP PLC                    | 55.59      | 48.41     | 23          | 3,059   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC                   | 358.12     | 339       | 32          | 4,287   | 電気設備                 |  |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額  | 27,838.29 | 22,701.25   | 10,779  | 1,420,113            |  |
|  | 銘柄数 < 比率 > | 93銘柄      | 92銘柄        | -       | <4.8%>               |  |
| <b>(イスラエル)</b>                           | 百株         | 百株        | 千イスラエル・シェケル | 千円      |                      |  |
| BANK HAPOALIM BM                         | 61.88      | 73.28     | 165         | 5,010   | 銀行                   |  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL BM                  | 87.82      | 117.26    | 223         | 6,788   | 銀行                   |  |
| BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 133        | -         | -           | -       | 各種電気通信サービス           |  |
| ELBIT SYSTEMS LTD                        | 1.45       | 1.45      | 69          | 2,100   | 航空宇宙・防衛              |  |
| ISRAEL DISCOUNT BANK LTD                 | -          | 92.36     | 106         | 3,224   | 銀行                   |  |
| ISRAEL CHEMICALS LTD                     | 42.09      | 42.09     | 53          | 1,615   | 化学                   |  |
| NICE LTD                                 | 3.58       | 5.32      | 323         | 9,807   | ソフトウェア               |  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD                 | 7.94       | 6.17      | 43          | 1,324   | 銀行                   |  |
| AZRIELI GROUP                            | 2.58       | 2.58      | 51          | 1,546   | 不動産管理・開発             |  |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額  | 340.34    | 340.51      | 1,036   | 31,419               |  |
|  | 銘柄数 < 比率 > | 8銘柄       | 8銘柄         | -       | <0.1%>               |  |
| <b>(スイス)</b>                             | 百株         | 百株        | 千スイス・フラン    | 千円      |                      |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG                   | 178.13     | 191.36    | 156         | 17,136  | 資本市場                 |  |
| NESTLE SA-REGISTERED                     | 202.95     | 225.28    | 2,337       | 255,819 | 食品                   |  |
| CIE FINANC RICHEMONT                     | 36.21      | 39.24     | 214         | 23,477  | 繊維・アパレル・贅沢品          |  |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN             | 46.58      | 53.12     | 1,816       | 198,783 | 医薬品                  |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT              | 3.32       | 3.32      | 69          | 7,628   | 機械                   |  |
| SIKA INHABER                             | 9.31       | 9.78      | 160         | 17,576  | 化学                   |  |
| SGS SA-REG                               | 0.39       | 0.49      | 104         | 11,479  | 専門サービス               |  |
| NOVARTIS AG-REG SHS                      | 143.71     | 162.45    | 1,351       | 147,854 | 医薬品                  |  |
| BALOISE HOLDING AG -R                    | 2.85       | 3.22      | 44          | 4,879   | 保険                   |  |
| BARRY CALLEBAUT AG                       | 0.13       | 0.19      | 35          | 3,856   | 食品                   |  |
| CLARIANT AG-REG                          | 11.79      | 8.24      | 14          | 1,578   | 化学                   |  |
| SWISSCOM AG-REG                          | 1.87       | 1.76      | 85          | 9,401   | 各種電気通信サービス           |  |
| ABB LTD                                  | 126.78     | 140.58    | 246         | 26,918  | 電気設備                 |  |
| ADECCO GROUP AG-REG                      | 13.27      | 9.91      | 40          | 4,443   | 専門サービス               |  |
| GEBERIT AG                               | 2.61       | 2.96      | 125         | 13,697  | 建設関連製品               |  |
| LONZA GROUP AG-REG                       | 5.17       | 5.71      | 251         | 27,509  | ライフサイエンス・ツール/サービス    |  |
| LINDT & SPRUENGLI PART                   | 0.06       | 0.07      | 53          | 5,905   | 食品                   |  |
| LINDT & SPRUENGLI NAMEN                  | 0.01       | 0.01      | 81          | 8,884   | 食品                   |  |
| GIVAUDAN-REG                             | 0.62       | 0.71      | 233         | 25,543  | 化学                   |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG                | 9.8        | 11.26     | 327         | 35,853  | 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 |             |  |
| (スイス)                        | 百株         | 百株       | 千スイス・フラン    | 千円          |             |  |
| LAFARGEHOLCIM LTD            | 33.92      | 37.78    | 147         | 16,184      | 建設資材        |  |
| TEMENOS GROUP                | 3.56       | 5.11     | 66          | 7,285       | ソフトウェア      |  |
| SONOVA HOLDING AG            | 3.27       | 3.91     | 73          | 8,049       | ヘルスケア機器・用品  |  |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG       | 3.16       | 3.65     | 49          | 5,377       | 海運業         |  |
| STRAUMANN HOLDING AG         | 0.61       | 0.86     | 63          | 6,950       | ヘルスケア機器・用品  |  |
| THE SWATCH GROUP AG-B        | 2.38       | 2.38     | 43          | 4,798       | 繊維・アパレル・贅沢品 |  |
| THE SWATCH GROUP AG-REG      | 3.44       | 4.34     | 15          | 1,691       | 繊維・アパレル・贅沢品 |  |
| SCHINDLER NAMEN              | 1.15       | 1.67     | 34          | 3,771       | 機械          |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG        | 2.41       | 2.38     | 79          | 8,718       | 保険          |  |
| VIFOR PHARMA AG              | 2.81       | 3        | 45          | 5,025       | 医薬品         |  |
| EMS-CHEMIE HOLDING           | 0.48       | 0.64     | 39          | 4,369       | 化学          |  |
| SWISS PRIME SITE AG          | 4.49       | 6.64     | 59          | 6,560       | 不動産管理・開発    |  |
| PARGESA HOLDING PORTEUR      | 2.29       | 2.29     | 15          | 1,718       | 各種金融サービス    |  |
| DUFREY GROUP                 | 2.05       | 4.82     | 12          | 1,328       | 専門小売り       |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 1.31       | 1.38     | 109         | 11,998      | 資本市場        |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 17.73      | 17.73    | 66          | 7,327       | 資本市場        |  |
| SWISS RE LTD                 | 19.91      | 22.59    | 150         | 16,481      | 保険          |  |
| ALCON INC                    | 28.74      | 31.41    | 164         | 17,981      | ヘルスケア機器・用品  |  |
| UBS GROUP AG                 | 261.69     | 292.82   | 281         | 30,810      | 資本市場        |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額  | 1,190.96 | 1,315.06    | 9,273       | 1,014,659   |  |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 39銘柄     | 39銘柄        | -           | <3.4%>      |  |
| (デンマーク)                      | 百株         | 百株       | 千デンマーク・クローネ | 千円          |             |  |
| CARLSBERG AS-B               | 6.72       | 9.43     | 782         | 12,097      | 飲料          |  |
| A P MOLLER A/S               | 0.39       | 0.39     | 247         | 3,822       | 海運業         |  |
| AP MOLLER MAERSK A           | 0.36       | 0.36     | 212         | 3,289       | 海運業         |  |
| DANSKE BANK A/S              | 51.74      | 51.74    | 399         | 6,180       | 銀行          |  |
| GENMAB A/S                   | 3.62       | 5.35     | 973         | 15,053      | バイオテクノロジー   |  |
| NOVOZYMES-B SHS              | 13.9       | 17.42    | 608         | 9,409       | 化学          |  |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 122.21     | 134.6    | 5,814       | 89,895      | 医薬品         |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 13.6       | 14.09    | 836         | 12,930      | 電気設備        |  |
| COLOPLAST-B                  | 8.88       | 8.51     | 895         | 13,840      | ヘルスケア機器・用品  |  |
| DSV PANALPINA A S            | 13.83      | 16.36    | 1,132       | 17,512      | 航空貨物・物流サービス |  |
| DEMANT A/S                   | 6.28       | 6.28     | 107         | 1,667       | ヘルスケア機器・用品  |  |
| H LUNDBECK A/S               | 4.34       | 4.34     | 105         | 1,627       | 医薬品         |  |
| TRYG A/S                     | 7.37       | 5.96     | 108         | 1,681       | 保険          |  |
| PANDORA A/S                  | 6.47       | 6.47     | 175         | 2,720       | 繊維・アパレル・贅沢品 |  |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 5.83       | 8.61     | 526         | 8,133       | 化学          |  |
| ISS A/S                      | 9.8        | 9.8      | 99          | 1,535       | 商業サービス・用品   |  |
| ORSTED A/S                   | 13.6       | 12.85    | 894         | 13,826      | 電力          |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額  | 288.94   | 312.56      | 13,921      | 215,225     |  |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 17銘柄     | 17銘柄        | -           | <0.7%>      |  |
| (ノルウェー)                      | 百株         | 百株       | 千ノルウェー・クローネ | 千円          |             |  |
| MOWI ASA                     | 31.65      | 26.53    | 464         | 4,831       | 食品          |  |
| DNB ASA                      | 66.93      | 76.17    | 883         | 9,201       | 銀行          |  |
| NORSK HYDRO ASA              | 81.67      | 147.69   | 354         | 3,691       | 金属・鉱業       |  |
| TELENOR ASA                  | 51.74      | 56.01    | 823         | 8,568       | 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      |                   |  |
| (ノルウェー)                            | 百株               | 百株               | 千ノルウェー・クローネ      | 千円          |                   |  |
| ORKLA ASA                          | 47.43            | 65.57            | 553              | 5,756       | 食品                |  |
| EQUINOR ASA                        | 78.4             | 68.57            | 950              | 9,889       | 石油・ガス・消耗燃料        |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA             | 10.41            | 13.6             | 472              | 4,914       | 化学                |  |
| AKER BP ASA                        | 6.68             | 6.68             | 113              | 1,179       | 石油・ガス・消耗燃料        |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA          | 12.53            | 12.53            | 220              | 2,295       | 保険                |  |
| SCHIBSTED ASA                      | 6.13             | 6.13             | 135              | 1,410       | メディア              |  |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 393.57<br>10銘柄   | 479.48<br>10銘柄   | 4,970<br>-  | 51,739<br><0.2%>  |  |
| (スウェーデン)                           | 百株               | 百株               | 千スウェーデン・クローナ     | 千円          |                   |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS               | 49.18            | 47.27            | 1,598            | 17,356      | 機械                |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS               | 22.94            | 32.93            | 1,006            | 10,936      | 機械                |  |
| ERICSSON LM-B SHS                  | 205.31           | 229.89           | 1,891            | 20,542      | 通信機器              |  |
| LUNDBERGS B                        | 4.77             | 4.77             | 193              | 2,104       | 各種金融サービス          |  |
| SKF AB-B SHS                       | 22.15            | 29.63            | 450              | 4,891       | 機械                |  |
| SANDVIK AB                         | 79.77            | 92.09            | 1,348            | 14,641      | 機械                |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A       | 111.7            | 119.16           | 889              | 9,658       | 銀行                |  |
| SKANSKA AB-B SHS                   | 20.8             | 23.18            | 415              | 4,516       | 建設・土木             |  |
| SWEDBANK AB                        | 60.48            | 66.51            | 713              | 7,745       | 銀行                |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS        | 104.46           | 120.17           | 1,052            | 11,434      | 銀行                |  |
| VOLVO AB-B SHS                     | 107.28           | 114.24           | 1,396            | 15,166      | 機械                |  |
| SWEDISH MATCH AB                   | 10.33            | 13.59            | 841              | 9,135       | タバコ               |  |
| TELE2 AB-B SHS                     | 29.44            | 44.57            | 554              | 6,026       | 無線通信サービス          |  |
| INDUSTRIVARDEN C                   | 10.07            | 10.07            | 201              | 2,185       | 各種金融サービス          |  |
| ELECTROLUX AB-SER B                | 14.06            | 16.88            | 229              | 2,491       | 家庭用耐久財            |  |
| SECURITAS AB-B SHS                 | 18.11            | 21.26            | 255              | 2,778       | 商業サービス・用品         |  |
| INVESTOR AB-B SHS                  | 31.32            | 35.01            | 1,663            | 18,067      | 各種金融サービス          |  |
| HENNES&MAURITZ AB-B SHS            | 51.51            | 59.46            | 778              | 8,449       | 専門小売り             |  |
| ASSA ABLOY AB-B                    | 68.22            | 78.46            | 1,426            | 15,490      | 建設関連製品            |  |
| TELIA CO AB                        | 200.7            | 210.3            | 679              | 7,376       | 各種電気通信サービス        |  |
| LUNDIN ENERGY AB                   | 11.58            | 19.11            | 435              | 4,727       | 石油・ガス・消耗燃料        |  |
| BOLIDEN AB                         | 16.63            | 21.55            | 409              | 4,447       | 金属・鉱業             |  |
| ALFA LAVAL AB                      | 17.93            | 27.83            | 513              | 5,580       | 機械                |  |
| KINNEVIK AB-B                      | 14.15            | 19.48            | 423              | 4,597       | 各種金融サービス          |  |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA | 3.9              | 6.57             | 151              | 1,643       | 無線通信サービス          |  |
| ICA GRUPPEN AB                     | 4.74             | 4.23             | 177              | 1,930       | 食品・生活必需品小売り       |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS                 | 26.11            | 26.11            | 151              | 1,645       | 家庭用耐久財            |  |
| HEXAGON AB                         | 15.17            | 18.95            | 879              | 9,548       | 電子装置・機器・部品        |  |
| EPIROC AB-A                        | 39.01            | 59.88            | 588              | 6,396       | 機械                |  |
| EPIROC AB-B                        | 22.62            | 22.62            | 221              | 2,401       | 機械                |  |
| ESSITY AB-B                        | 42.34            | 44.75            | 1,370            | 14,885      | 家庭用品              |  |
| NORDEA BANK ABP                    | 201.16           | 218.71           | 1,300            | 14,120      | 銀行                |  |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,637.94<br>32銘柄 | 1,859.23<br>32銘柄 | 24,209<br>- | 262,920<br><0.9%> |  |
| (ユーロ・・・アイルランド)                     | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円          |                   |  |
| CRH PLC                            | 58.81            | 62.15            | 167              | 19,271      | 建設資材              |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC          | 4.86             | 4.78             | 52               | 6,112       | 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 |                   |  |
| (ユーロ・・・アイルランド)                | 百株         | 百株       | 千ユーロ      | 千円          |                   |  |
| KERRY GROUP PLC-A             | 11.23      | 11.58    | 116       | 13,425      | 食品                |  |
| KINGSPAN GROUP PLC            | 9.1        | 9.49     | 46        | 5,329       | 建設関連製品            |  |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC       | 13.35      | 18.25    | 52        | 6,046       | 容器・包装             |  |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC     | 57.7       | 111.23   | 18        | 2,100       | 銀行                |  |
| AIB GROUP PLC                 | 51.83      | 51.83    | 5         | 593         | 銀行                |  |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額  | 206.88   | 269.31    | 458         | 52,879            |  |
|                               | 銘柄数 < 比率 > | 7銘柄      | 7銘柄       | -           | <0.2%>            |  |
| (ユーロ・・・オランダ)                  | 百株         | 百株       | 千ユーロ      | 千円          |                   |  |
| AIRBUS SE                     | 38.97      | 44.75    | 249       | 28,780      | 航空宇宙・防衛           |  |
| KONINKLIJKE DSM NV            | 13.61      | 13.77    | 158       | 18,267      | 化学                |  |
| ING GROEP NV-CVA              | 266.83     | 291.51   | 142       | 16,454      | 銀行                |  |
| RANDSTAD NV                   | 6.95       | 7.26     | 26        | 3,030       | 専門サービス            |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 83.38      | 81.55    | 186       | 21,571      | 食品・生活必需品小売り       |  |
| HEINEKEN NV                   | 17.61      | 19.4     | 143       | 16,565      | 飲料                |  |
| AKZO NOBEL                    | 15.26      | 15.98    | 111       | 12,900      | 化学                |  |
| ASML HOLDING NV               | 27.58      | 32.27    | 892       | 102,968     | 半導体・半導体製造装置       |  |
| AEGON NV                      | 136.47     | 125.73   | 27        | 3,228       | 保険                |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV        | 65.95      | 68.27    | 270       | 31,242      | ヘルスケア機器・用品        |  |
| WOLTERS KLUWER-CVA            | 20.83      | 21.51    | 143       | 16,585      | 専門サービス            |  |
| STMICROELECTRONICS NV         | 40.15      | 50.38    | 116       | 13,442      | 半導体・半導体製造装置       |  |
| QIAGEN N.V.                   | 18.11      | 18.11    | 70        | 8,124       | ライフサイエンス・ツール/サービス |  |
| VOPAK (KON.)                  | 4.32       | 4.32     | 21        | 2,509       | 石油・ガス・消耗燃料        |  |
| KONINKLIJKE KPN NV            | 259.1      | 238.68   | 50        | 5,798       | 各種電気通信サービス        |  |
| HEINEKEN HOLDING NV-A         | 8.61       | 9.37     | 64        | 7,458       | 飲料                |  |
| UNILEVER NV                   | 102.58     | 112.22   | 501       | 57,867      | パーソナル用品           |  |
| FERRARI NV                    | 8.72       | 9.87     | 143       | 16,583      | 自動車               |  |
| CNH INDUSTRIAL NV             | 74.74      | 51.1     | 25        | 2,929       | 機械                |  |
| PROSUS NV                     | -          | 37.1     | 262       | 30,327      | インターネット販売・通信販売    |  |
| NN GROUP NV                   | 17.83      | 20.94    | 54        | 6,239       | 保険                |  |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV  | 74.17      | 68.65    | 52        | 6,018       | 自動車               |  |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV      | -          | 9.05     | 88        | 10,229      | インターネット販売・通信販売    |  |
| ABN AMRO BANK NV              | 24.81      | 35.03    | 23        | 2,711       | 銀行                |  |
| EXOR NV                       | 6.36       | 9.46     | 45        | 5,205       | 各種金融サービス          |  |
| ALTICE EUROPE NV              | -          | 53.78    | 19        | 2,272       | メディア              |  |
| ADYEN NV                      | 0.51       | 0.82     | 78        | 9,020       | 情報技術サービス          |  |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額  | 1,333.45 | 1,450.88  | 3,973       | 458,336           |  |
|                               | 銘柄数 < 比率 > | 24銘柄     | 27銘柄      | -           | <1.5%>            |  |
| (ユーロ・・・ベルギー)                  | 百株         | 百株       | 千ユーロ      | 千円          |                   |  |
| UMICORE                       | 12.33      | 12.24    | 44        | 5,166       | 化学                |  |
| KBC GROUPE                    | 17.17      | 20.39    | 99        | 11,502      | 銀行                |  |
| SOLVAY SA                     | 4.62       | 6.81     | 49        | 5,695       | 化学                |  |
| AGEAS                         | 10.66      | 10.81    | 36        | 4,223       | 保険                |  |
| UCB SA                        | 7.4        | 9.19     | 76        | 8,867       | 医薬品               |  |
| COLRUYT NV                    | 3.57       | 3.57     | 20        | 2,384       | 食品・生活必需品小売り       |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   | 4.74       | 8.01     | 57        | 6,636       | 各種金融サービス          |  |
| PROXIMUS                      | 9.01       | 9.01     | 16        | 1,870       | 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 |                   |  |
| (ユーロ・・・ベルギー)                        | 百株         | 百株     | 千ユーロ      | 千円          |                   |  |
| GALAPAGOS NV                        | —          | 3.65   | 76        | 8,829       | バイオテクノロジー         |  |
| TELENET GROUP HOLDING NV            | 3.4        | 3.4    | 11        | 1,348       | メディア              |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV          | 51.78      | 53.88  | 212       | 24,545      | 飲料                |  |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額  | 124.68 | 140.96    | 702         | 81,070            |  |
|                                     | 銘柄数 < 比率 > | 10銘柄   | 11銘柄      | —           | <0.3%>            |  |
| (ユーロ・・・ルクセンブルグ)                     | 百株         | 百株     | 千ユーロ      | 千円          |                   |  |
| ARCELOR MITTAL (NL)                 | 48.85      | 59.16  | 60        | 6,968       | 金属・鉱業             |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC                 | 0.67       | 0.73   | 38        | 4,491       | ライフサイエンス・ツール/サービス |  |
| TENARIS SA                          | 28.7       | 28.7   | 17        | 2,045       | エネルギー設備・サービス      |  |
| SES FDR                             | 21.39      | 37.21  | 21        | 2,432       | メディア              |  |
| RTL GROUP SA                        | 1.89       | —      | —         | —           | メディア              |  |
| AROUNDTOWN SA                       | 45.74      | 72.07  | 36        | 4,233       | 不動産管理・開発          |  |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額  | 147.24 | 197.87    | 174         | 20,171            |  |
|                                     | 銘柄数 < 比率 > | 6銘柄    | 5銘柄       | —           | <0.1%>            |  |
| (ユーロ・・・フランス)                        | 百株         | 百株     | 千ユーロ      | 千円          |                   |  |
| AIR LIQUIDE                         | 28.66      | 36.27  | 435       | 50,188      | 化学                |  |
| AXA                                 | 125.98     | 150.03 | 244       | 28,200      | 保険                |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 39.36      | 38.06  | 72        | 8,401       | 総合公益事業            |  |
| DASSAULT AVIATION SA                | 0.15       | 0.17   | 11        | 1,373       | 航空宇宙・防衛           |  |
| DANONE                              | 42.28      | 46.84  | 294       | 34,020      | 食品                |  |
| SAFRAN SA                           | 22.19      | 25.13  | 203       | 23,505      | 航空宇宙・防衛           |  |
| ACCOR SA                            | 15.39      | 9.22   | 21        | 2,451       | ホテル・レストラン・レジャー    |  |
| BOUYGUES                            | 12.87      | 20.29  | 55        | 6,415       | 建設・土木             |  |
| BNP PARIBAS                         | 75.38      | 87.4   | 249       | 28,729      | 銀行                |  |
| THALES SA                           | 6.23       | 8.71   | 60        | 7,033       | 航空宇宙・防衛           |  |
| CAPGEMINI SA                        | 11.3       | 10.3   | 92        | 10,646      | 情報技術サービス          |  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON           | 3.36       | 3.36   | 11        | 1,352       | 食品・生活必需品小売り       |  |
| INGENICO GROUP                      | 3.67       | 3.67   | 43        | 5,029       | 電子装置・機器・部品        |  |
| NATIXIS                             | 55.8       | 42.79  | 9         | 1,050       | 資本市場              |  |
| EIFFAGE                             | 4.65       | 4.98   | 36        | 4,209       | 建設・土木             |  |
| PUBLICIS GROUPE                     | 15.27      | 14.41  | 36        | 4,225       | メディア              |  |
| FAURECIA                            | 4.75       | 4.75   | 14        | 1,726       | 自動車部品             |  |
| IMERYS SA                           | 2.23       | —      | —         | —           | 建設資材              |  |
| L'OREAL                             | 16.71      | 19.04  | 474       | 54,691      | パーソナル用品           |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 18.61      | 21.09  | 728       | 84,070      | 繊維・アパレル・贅沢品       |  |
| BOLLORE                             | 54.61      | 54.61  | 13        | 1,544       | 娯楽                |  |
| MICHELIN(CGDE)-B                    | 12.18      | 13.88  | 121       | 13,988      | 自動車部品             |  |
| PERNOD-RICARD                       | 14.54      | 16.19  | 218       | 25,185      | 飲料                |  |
| PEUGEOT SA                          | 40.95      | 39.89  | 51        | 5,954       | 自動車               |  |
| RENAULT SA                          | 13.91      | 18.3   | 31        | 3,608       | 自動車               |  |
| REMY COINTREAU                      | 1.39       | 1.39   | 13        | 1,581       | 飲料                |  |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN           | 35.57      | 35.87  | 87        | 10,063      | 建設関連製品            |  |
| SEB SA                              | 1.43       | 1.43   | 15        | 1,801       | 家庭用耐久財            |  |
| SOCIETE GENERALE-A                  | 52.07      | 53.47  | 69        | 8,059       | 銀行                |  |
| VINCI S.A.                          | 34.28      | 39.81  | 294       | 33,947      | 建設・土木             |  |
| SODEXO                              | 5.3        | 6.98   | 44        | 5,129       | 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 |                         |  |
| (ユーロ・・・フランス)                | 百株         | 百株       | 千ユーロ      | 千円          |                         |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE       | 37.5       | 42.36    | 335       | 38,760      | 電気設備                    |  |
| VIVENDI SA                  | 71.09      | 61.04    | 119       | 13,731      | 娯楽                      |  |
| TOTAL SA                    | 159.45     | 180.85   | 589       | 67,950      | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| VALEO                       | 14.13      | 23.76    | 47        | 5,498       | 自動車部品                   |  |
| ORANGE                      | 136.47     | 147.13   | 157       | 18,144      | 各種電気通信サービス              |  |
| HERMES INTL                 | 2.19       | 2.33     | 156       | 18,067      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| SOCIETE BIC SA              | 1.57       | —        | —         | —           | 商業サービス・用品               |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA        | 9.07       | 9.21     | 128       | 14,810      | ソフトウェア                  |  |
| KERING                      | 5.17       | 5.78     | 255       | 29,515      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| CNP ASSURANCES              | 9.82       | 22.68    | 20        | 2,391       | 保険                      |  |
| CARREFOUR SA                | 34.75      | 47.24    | 62        | 7,256       | 食品・生活必需品小売り             |  |
| ATOS SE                     | 5.64       | 7.57     | 48        | 5,627       | 情報技術サービス                |  |
| SANOFI                      | 75.17      | 85.65    | 777       | 89,666      | 医薬品                     |  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT       | 4.83       | 6.66     | 48        | 5,579       | 娯楽                      |  |
| TELEPERFORMANCE             | 3.39       | 4.21     | 94        | 10,864      | 専門サービス                  |  |
| EURAZEO                     | 2.89       | 3.03     | 12        | 1,490       | 各種金融サービス                |  |
| JC DECAUX SA                | 4.67       | 4.67     | 8         | 1,010       | メディア                    |  |
| ESSILORLUXOTTICA            | 19.6       | 21.5     | 238       | 27,456      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| CREDIT AGRICOLE SA          | 81.32      | 95.36    | 68        | 7,896       | 銀行                      |  |
| WENDEL                      | 1.73       | 1.34     | 9         | 1,143       | 各種金融サービス                |  |
| ILIAD SA                    | 1.66       | 1.66     | 23        | 2,762       | 各種電気通信サービス              |  |
| BIOMERIEUX                  | 2.58       | 2.58     | 30        | 3,520       | ヘルスケア機器・用品              |  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH    | 1.61       | 1.97     | 43        | 5,040       | ライフサイエンス・ツール/サービス       |  |
| ENGIE                       | 123.21     | 127.09   | 123       | 14,206      | 総合公益事業                  |  |
| ALSTOM                      | 9.06       | 14.92    | 52        | 6,063       | 機械                      |  |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS     | 10.87      | 10.87    | 10        | 1,181       | メディア                    |  |
| ELECTRICITE DE FRANCE       | 35.48      | 47.62    | 33        | 3,915       | 電力                      |  |
| IPSEN SA                    | 2.2        | 2.27     | 15        | 1,740       | 医薬品                     |  |
| ARKEMA SA                   | 6          | 6        | 44        | 5,170       | 化学                      |  |
| LEGRAND SA                  | 19.86      | 22.35    | 128       | 14,866      | 電気設備                    |  |
| ADP                         | 1.73       | 2.51     | 20        | 2,322       | 運送インフラ                  |  |
| SCOR SE                     | 9.53       | 14.38    | 34        | 4,034       | 保険                      |  |
| REXEL SA                    | 18.8       | —        | —         | —           | 商社・流通業                  |  |
| BUREAU VERITAS SA           | 24.1       | 24.1     | 44        | 5,123       | 専門サービス                  |  |
| GETLINK                     | 27.2       | 33.77    | 37        | 4,300       | 運送インフラ                  |  |
| SUEZ SA                     | 21.86      | 15.14    | 15        | 1,772       | 総合公益事業                  |  |
| EDENRED                     | 14.04      | 17.64    | 66        | 7,694       | 情報技術サービス                |  |
| WORLDLINE SA                | 2.25       | 10.08    | 66        | 7,616       | 情報技術サービス                |  |
| AMUNDI SA                   | 3.68       | 3.68     | 22        | 2,540       | 資本市場                    |  |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額  | 1,787.24 | 1,959.33  | 8,052       | 928,921                 |  |
|                             | 銘柄数 < 比率 > | 70銘柄     | 67銘柄      | —           | <3.1%>                  |  |
| (ユーロ・・・ドイツ)                 | 百株         | 百株       | 千ユーロ      | 千円          |                         |  |
| ADIDAS AG                   | 12.57      | 13.79    | 288       | 33,263      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 22.68      | 24.77    | 122       | 14,105      | 自動車                     |  |
| COMMERZBANK AG              | 59.18      | 65.66    | 21        | 2,459       | 銀行                      |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA      | 28.31      | 32.7     | 128       | 14,877      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・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 |                         |
| (ユーロ・・・ドイツ)                       | 百株      | 百株     | 千ユーロ  | 千円     |                         |
| UNITED INTERNET                   | 7.32    | 4.42   | 14    | 1,616  | 各種電気通信サービス              |
| FUCHS PETROLUB SE PREF            | 4.09    | 4.09   | 14    | 1,656  | 化学                      |
| HANNOVER RUECK SE                 | 3.54    | 4.93   | 69    | 8,024  | 保険                      |
| GEA GROUP AG                      | 9.98    | 9.98   | 21    | 2,529  | 機械                      |
| CONTINENTAL AG                    | 7.66    | 7.44   | 55    | 6,433  | 自動車部品                   |
| DEUTSCHE POST AG-REG              | 66.51   | 74.33  | 196   | 22,654 | 航空貨物・物流サービス             |
| AXEL SPRINGER SE                  | 2.84    | -      | -     | -      | メディア                    |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD        | 8.99    | 13.14  | 60    | 6,971  | 自動車                     |
| MERCK KGAA                        | 9.19    | 9.73   | 102   | 11,819 | 医薬品                     |
| RWE AG                            | 30.57   | 39.8   | 106   | 12,272 | 総合公益事業                  |
| SAP SE                            | 65.36   | 74.36  | 798   | 92,078 | ソフトウェア                  |
| E.ON SE                           | 148.95  | 173.87 | 157   | 18,168 | 総合公益事業                  |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 6.07    | 7.95   | 55    | 6,424  | 家庭用品                    |
| SIEMENS AG-REG                    | 50.99   | 58.28  | 491   | 56,683 | コンプロマリット                |
| PUMA AG                           | 0.48    | 6.21   | 36    | 4,245  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| BAYER AG                          | 62.79   | 74.53  | 431   | 49,798 | 医薬品                     |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG        | 12.59   | 13.96  | 108   | 12,561 | 家庭用品                    |
| DAIMLER AG                        | 61.36   | 67.38  | 202   | 23,392 | 自動車                     |
| BASF SE                           | 62.01   | 68.83  | 313   | 36,191 | 化学                      |
| BEIERSDORF AG                     | 5.91    | 8.05   | 74    | 8,565  | パーソナル用品                 |
| HOCHTIEF AG                       | 1.25    | 1.69   | 11    | 1,343  | 建設・土木                   |
| HEIDELBERGCEMENT AG               | 11.3    | 9.02   | 37    | 4,359  | 建設資材                    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO    | 15.3    | 16     | 113   | 13,104 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE                        | 28.41   | 31.53  | 495   | 57,105 | 保険                      |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE           | 13.78   | -      | -     | -      | メディア                    |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG            | 14.22   | 14.22  | 11    | 1,289  | 旅客航空輸送業                 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG        | 10.01   | 11.14  | 217   | 25,046 | 保険                      |
| VOLKSWAGEN AG                     | 1.86    | 2.79   | 37    | 4,354  | 自動車                     |
| VOLKSWAGEN AG PFD                 | 12.62   | 13.61  | 173   | 19,961 | 自動車                     |
| THYSSENKRUPP AG                   | 25.81   | 45.08  | 24    | 2,782  | 金属・鉱業                   |
| 1&1 DRILLISCH AG                  | 2.86    | -      | -     | -      | 無線通信サービス                |
| DEUTSCHE BANK AG-REG              | 137.3   | 144.97 | 95    | 10,962 | 資本市場                    |
| BMW VORZUG                        | 3.14    | 5.59   | 23    | 2,676  | 自動車                     |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG           | 223.11  | 256.19 | 340   | 39,262 | 各種電気通信サービス              |
| SARTORIUS AG                      | 2.07    | 2.81   | 78    | 9,076  | ヘルスケア機器・用品              |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 79.72   | 96.58  | 175   | 20,277 | 半導体・半導体製造装置             |
| CARL ZEISS MEDITEC AG             | -       | 3.01   | 28    | 3,333  | ヘルスケア機器・用品              |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 13      | 14.55  | 215   | 24,908 | 資本市場                    |
| FRAPORT AG                        | 2.44    | 2.44   | 8     | 1,006  | 運送インフラ                  |
| WIRECARD AG                       | 8.05    | 8.82   | 74    | 8,568  | 情報技術サービス                |
| LANXESS AG                        | 5.14    | 6.61   | 30    | 3,493  | 化学                      |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG       | 3.06    | 3.82   | 49    | 5,656  | 航空宇宙・防衛                 |
| DEUTSCHE WOHNEN                   | 25.11   | 29.28  | 111   | 12,852 | 不動産管理・開発                |
| SYMRISE AG                        | 9.14    | 8.6    | 80    | 9,286  | 化学                      |
| BRENNTAG AG                       | 9.08    | 12.1   | 52    | 6,046  | 商社・流通業                  |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 9.62    | 20.43  | 44    | 5,180  | 化学                      |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 44.47   | 70.89  | 18    | 2,126  | 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 |                    |  |
| (ユーロ・・・ドイツ)                     | 百株                      | 百株               | 千ユーロ             | 千円          |                    |  |
| HUGO BOSS AG-ORD                | 3.72                    | -                | -                | -           | 繊維・アパレル・贅沢品        |  |
| OSRAM LICHT AG                  | 5.77                    | -                | -                | -           | 電気設備               |  |
| KION GROUP AG                   | 4.18                    | 4.18             | 18               | 2,170       | 機械                 |  |
| VONOVIA SE                      | 33.46                   | 40.11            | 195              | 22,496      | 不動産管理・開発           |  |
| KNORR-BREMSE AG                 | -                       | 3.84             | 31               | 3,594       | 機械                 |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG         | 8.81                    | 8.01             | 32               | 3,786       | ヘルスケア機器・用品         |  |
| METRO AG                        | 9.85                    | 9.85             | 7                | 857         | 食品・生活必需品小売り        |  |
| INNOGY SE                       | 8.18                    | -                | -                | -           | 総合公益事業             |  |
| ZALANDO SE                      | 6.52                    | 11.38            | 60               | 7,023       | インターネット販売・通信販売     |  |
| COVESTRO AG                     | 11.34                   | 15.33            | 46               | 5,420       | 化学                 |  |
| UNIPER SE                       | 11.84                   | 10.89            | 26               | 3,082       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |  |
| DELIVERY HERO SE                | 5.16                    | 9.79             | 83               | 9,680       | 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 > | 1,570.64<br>61銘柄 | 1,803.35<br>57銘柄 | 6,925<br>-  | 798,969<br><2.7%>  |  |
| (ユーロ・・・ポルトガル)                   | 百株                      | 百株               | 千ユーロ             | 千円          |                    |  |
| JERONIMO MARTINS                | 15.09                   | 15.09            | 23               | 2,699       | 食品・生活必需品小売り        |  |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA         | 200.43                  | 214.87           | 83               | 9,642       | 電力                 |  |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS     | 29.14                   | 43.39            | 45               | 5,195       | 石油・ガス・消耗燃料         |  |
| 小 計                             | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄数 < 比率 > | 244.66<br>3銘柄    | 273.35<br>3銘柄    | 152<br>-    | 17,537<br><0.1%>   |  |
| (ユーロ・・・スペイン)                    | 百株                      | 百株               | 千ユーロ             | 千円          |                    |  |
| IBERDROLA SA                    | 415.87                  | 467.05           | 412              | 47,618      | 電力                 |  |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 14.6                    | 14.6             | 19               | 2,267       | 電気設備               |  |
| REPSOL SA                       | 93.98                   | 88.94            | 78               | 9,002       | 石油・ガス・消耗燃料         |  |
| TELEFONICA S.A                  | 318.13                  | 362.72           | 155              | 17,925      | 各種電気通信サービス         |  |
| ENDESA S.A.                     | 18.57                   | 26.11            | 52               | 6,045       | 電力                 |  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV     | 19.23                   | 15.74            | 36               | 4,252       | 建設・土木              |  |
| BANKINTER S.A.                  | 39.11                   | 59.4             | 20               | 2,359       | 銀行                 |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA    | 452.23                  | 486.81           | 131              | 15,123      | 銀行                 |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA         | 20.57                   | 16.49            | 26               | 3,085       | ガス                 |  |
| BANCO SANTANDER SA              | 1,086.21                | 1,262.68         | 247              | 28,535      | 銀行                 |  |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 32.83                   | 27.74            | 42               | 4,937       | 電力                 |  |
| BANCO SABADELL                  | 329.93                  | 465.17           | 15               | 1,803       | 銀行                 |  |
| INDITEX                         | 72.8                    | 82.95            | 193              | 22,372      | 専門小売り              |  |
| MAPFRE SA                       | 67.36                   | 67.36            | 11               | 1,272       | 保険                 |  |
| ENAGAS                          | 13.12                   | 24.22            | 49               | 5,710       | ガス                 |  |
| GRIFOLS SA                      | 17.49                   | 25.29            | 73               | 8,489       | バイオテクノロジー          |  |
| FERROVIAL SA                    | 36.15                   | 34.19            | 75               | 8,740       | 建設・土木              |  |
| CAIXABANK                       | 254.06                  | 298.33           | 48               | 5,647       | 銀行                 |  |
| AMADEUS IT GROUP SA             | 30                      | 33.08            | 132              | 15,241      | 情報技術サービス           |  |
| BANKIA SA                       | 78.06                   | 78.06            | 7                | 819         | 銀行                 |  |
| AENA SME SA                     | 3.95                    | 5.28             | 57               | 6,633       | 運送インフラ             |  |
| CELLNEX TELECOM SAU             | -                       | 21.35            | 104              | 12,063      | 各種電気通信サービス         |  |
| 小 計                             | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄数 < 比率 > | 3,414.25<br>21銘柄 | 3,963.56<br>22銘柄 | 1,993<br>-  | 229,948<br><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…イタリア)                    | 百株         | 百株         | 千ユーロ      | 千円          |             |
| ASSICURAZIONI GENERALI        | 79.5       | 80.02      | 102       | 11,834      | 保険          |
| INTESA SANPAOLO               | 998.25     | 1,156      | 162       | 18,723      | 銀行          |
| UNICREDIT SPA                 | 135.36     | 143.54     | 93        | 10,756      | 銀行          |
| ENI SPA                       | 171.9      | 189.56     | 162       | 18,709      | 石油・ガス・消耗燃料  |
| MEDIOBANCA SPA                | 35.94      | 32.2       | 16        | 1,909       | 銀行          |
| ENEL SPA                      | 540.9      | 616.95     | 381       | 44,040      | 電力          |
| LEONARDO SPA                  | 24.96      | 24.96      | 14        | 1,724       | 航空宇宙・防衛     |
| SNAM SPA                      | 166.86     | 166.86     | 66        | 7,705       | ガス          |
| TELECOM ITALIA SPA            | 679.63     | 1,147.57   | 39        | 4,527       | 各種電気通信サービス  |
| TELECOM ITALIA-RNC            | 343.57     | 343.57     | 11        | 1,367       | 各種電気通信サービス  |
| ATLANTIA SPA                  | 28.99      | 38.99      | 51        | 5,986       | 運送インフラ      |
| TERNA SPA                     | 84.28      | 132.78     | 75        | 8,654       | 電力          |
| RECORDATI SPA                 | 6.56       | 6.56       | 26        | 3,095       | 医薬品         |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA     | 35.8       | 44.8       | 31        | 3,633       | 飲料          |
| PRYSMIAN SPA                  | 14.86      | 25.14      | 43        | 5,050       | 電気設備        |
| MONCLER SPA                   | 11.03      | 11.64      | 38        | 4,470       | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FINECOBANK SPA                | -          | 29.18      | 27        | 3,176       | 銀行          |
| POSTE ITALIANE SPA            | 32.15      | 31.4       | 22        | 2,618       | 保険          |
| PIRELLI & C SPA               | 25.42      | 25.42      | 9         | 1,085       | 自動車部品       |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額  | 株 数 ・ 金 額  | 1,378     | 159,069     |             |
|                               | 銘柄数 < 比率 > | 銘柄数 < 比率 > | -         | <0.5%>      |             |
| (ユーロ…フィンランド)                  | 百株         | 百株         | 千ユーロ      | 千円          |             |
| WARTSILA OYJ                  | 25.98      | 40.56      | 27        | 3,125       | 機械          |
| NOKIAN RENKAAT OYJ            | 7.37       | 7.37       | 13        | 1,589       | 自動車部品       |
| UPM-KYMMENE OYJ               | 39.32      | 39.23      | 98        | 11,386      | 紙製品・林産品     |
| STORA ENSO OYJ-R SHS          | 32.24      | 58.56      | 60        | 7,029       | 紙製品・林産品     |
| SAMPO OYJ-A SHS               | 29.39      | 33.53      | 101       | 11,758      | 保険          |
| FORTUM OYJ                    | 26.1       | 36.67      | 55        | 6,383       | 電力          |
| NOKIA OYJ                     | 377.99     | 434.21     | 143       | 16,554      | 通信機器        |
| ELISA OYJ                     | 8.37       | 9.76       | 52        | 6,037       | 各種電気通信サービス  |
| METSO OYJ                     | 6.47       | 6.47       | 16        | 1,856       | 機械          |
| NESTE OYJ                     | 22.53      | 31.75      | 98        | 11,346      | 石油・ガス・消耗燃料  |
| KONE OYJ                      | 23.32      | 25.66      | 143       | 16,606      | 機械          |
| ORION OYJ                     | 6.46       | 6.46       | 29        | 3,375       | 医薬品         |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額  | 株 数 ・ 金 額  | 841       | 97,050      |             |
|                               | 銘柄数 < 比率 > | 銘柄数 < 比率 > | -         | <0.3%>      |             |
| (ユーロ…オーストリア)                  | 百株         | 百株         | 千ユーロ      | 千円          |             |
| OMV AG                        | 8.6        | 12.98      | 40        | 4,671       | 石油・ガス・消耗燃料  |
| VERBUND AG                    | 4.04       | 4.04       | 17        | 1,977       | 電力          |
| VOEST-ALPINE AG               | 7.18       | 7.18       | 13        | 1,562       | 金属・鉱業       |
| ERSTE GROUP BANK AG           | 22.22      | 22.11      | 42        | 4,881       | 銀行          |
| ANDRITZ AG                    | 4.42       | 4.42       | 13        | 1,562       | 機械          |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL | 9.15       | 9.15       | 14        | 1,662       | 銀行          |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額  | 株 数 ・ 金 額  | 141       | 16,318      |             |
|                               | 銘柄数 < 比率 > | 銘柄数 < 比率 > | -         | <0.1%>      |             |
| 合 計                           | 株 数 ・ 金 額  | 株 数 ・ 金 額  | -         | 27,594,088  |             |
|                               | 銘柄数 < 比率 > | 銘柄数 < 比率 > | -         | <93.2%>     |             |

(注1) 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。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## (2) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄                               | 期首(前期末)    |            | 当 期 末       |         |
|----------------------------------|------------|------------|-------------|---------|
|                                  | □ 数        | □ 数        | □ 数         | □ 数     |
| (アメリカ)                           | 千口         | 千口         | 千アメリカ・ドル    | 千円      |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT     | 0.762      | 0.923      | 139         | 14,871  |
| BOSTON PROPERTIES INC            | 1.06       | 1.102      | 94          | 10,062  |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC        | -          | 1.699      | 44          | 4,774   |
| SL GREEN                         | 0.701      | 0.701      | 32          | 3,484   |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT        | 9.229      | 10.589     | 64          | 6,858   |
| PROLOGIS INC                     | 4.214      | 5.58       | 491         | 52,268  |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC        | 0.92       | 1.022      | 163         | 17,439  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST            | 0.546      | 0.769      | 67          | 7,137   |
| EQUINIX INC                      | 0.53       | 0.648      | 437         | 46,545  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC   | 0.923      | 1.41       | 43          | 4,675   |
| DUKE REALTY TRUST                | 2.102      | 2.996      | 99          | 10,588  |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP  | 2.76       | 3.156      | 488         | 51,925  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC         | 0.451      | 0.452      | 112         | 11,973  |
| EQUITY RESIDENTIAL               | 2.494      | 2.701      | 170         | 18,112  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST        | 0.433      | 0.67       | 50          | 5,343   |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC        | 2.768      | 3.918      | 91          | 9,772   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP          | 0.783      | 0.859      | 245         | 26,141  |
| WELLTOWER INC                    | 2.472      | 3.021      | 126         | 13,495  |
| KIMCO REALTY                     | 2.48       | 3.334      | 33          | 3,563   |
| LIBERTY PROPERTY TRUST           | 0.869      | -          | -           | -       |
| IRON MOUNTAIN INC                | 1.603      | 2.306      | 56          | 6,021   |
| THE MACERICH COMPANY             | 0.623      | -          | -           | -       |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES      | -          | 1.468      | 89          | 9,480   |
| HOST HOTELS & RESORTS INC        | 5.314      | 4.826      | 53          | 5,671   |
| MID AMERICA                      | 0.83       | 0.996      | 113         | 12,050  |
| REALTY INCOME CORP               | 1.984      | 2.294      | 124         | 13,275  |
| REGENCY CENTERS CORP             | 0.897      | 1.001      | 39          | 4,164   |
| UDR INC                          | 1.994      | 2.464      | 93          | 9,916   |
| SIMON PROPERTY GROUP INC         | 2.003      | 2.316      | 132         | 14,040  |
| PUBLIC STORAGE                   | 1.014      | 1.133      | 207         | 22,114  |
| SUN COMMUNITIES INC              | -          | 0.73       | 95          | 10,168  |
| VENTAS INC                       | 2.365      | 2.748      | 74          | 7,914   |
| VORNADO REALTY TRUST             | 1.271      | 1.1        | 41          | 4,409   |
| WEYERHAEUSER CO                  | 5.271      | 5.751      | 107         | 11,395  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC          | 0.745      | 1.024      | 90          | 9,602   |
| DIGITAL REALTY TRUST INC         | 1.4        | 2.003      | 298         | 31,749  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST         | -          | 3.874      | 65          | 6,992   |
| AGNC INVESTMENT CORP             | 3.021      | 4.066      | 51          | 5,436   |
| VEREIT INC                       | 5.694      | 9.014      | 47          | 5,052   |
| AMERICAN TOWER CORP              | 2.909      | 3.354      | 789         | 83,921  |
| WP CAREY INC                     | 0.947      | 1.492      | 90          | 9,668   |
| INVITATION HOMES INC             | 1.839      | 4.384      | 107         | 11,475  |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC     | 0.945      | -          | -           | -       |
| VICI PROPERTIES INC              | -          | 3.569      | 59          | 6,289   |
| 小 計                              | □ 数        | □ 数        | □ 数         | □ 数     |
|                                  | 金額         | 金額         | 金額          | 金額      |
|                                  | 79.166     | 107.463    | 5,827       | 619,848 |
|                                  | 銘柄数 < 比率 > | 銘柄数 < 比率 > |             |         |
|                                  | 39銘柄<1.9%> | 41銘柄<2.1%> | -           | -       |
| (カナダ)                            | 千口         | 千口         | 千カナダ・ドル     | 千円      |
| SMARTCENTRES REIT                | 0.439      | 0.439      | 8           | 661     |
| CANADIAN APT PPTYS REIT          | -          | 0.371      | 17          | 1,363   |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT     | 0.89       | 0.89       | 8           | 617     |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | -          | 1.227      | 15          | 1,218   |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST  | 0.957      | 0.957      | 14          | 1,074   |
| 小 計                              | □ 数        | □ 数        | □ 数         | □ 数     |
|                                  | 金額         | 金額         | 金額          | 金額      |
|                                  | 2.286      | 3.884      | 64          | 4,935   |
|                                  | 銘柄数 < 比率 > | 銘柄数 < 比率 > |             |         |
|                                  | 3銘柄<0.0%>  | 5銘柄<0.0%>  | -           | -       |
| (オーストラリア)                        | 千口         | 千口         | 千オーストラリア・ドル | 千円      |
| MIRVAC GROUP                     | 21.484     | 21.917     | 47          | 3,316   |
| GPT GROUP                        | 14.397     | 11.931     | 46          | 3,205   |
| STOCKLAND                        | 20.553     | 15.847     | 43          | 3,014   |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |            | 当期         |             | 末       |
|------------------------------|---------|------------|------------|-------------|---------|
|                              | □数      | □数         | □数         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |
| <b>(オーストラリア)</b>             | 千□      | 千□         | 千□         | 千オーストラリア・ドル | 千円      |
| DEXUS                        | 7.954   | 7.062      | 61         |             | 4,265   |
| GOODMAN GROUP                | 11.687  | 13.462     | 189        |             | 13,186  |
| VICINITY CENTRES             | 19.022  | 35.904     | 48         |             | 3,389   |
| SCENTRE GROUP                | 37.083  | 36.515     | 77         |             | 5,373   |
| 小計                           | □数・金額   | 132.18     | 142.638    | 515         | 35,751  |
|                              | 銘柄数<比率> | 7銘柄<0.2%>  | 7銘柄<0.1%>  | -           | -       |
| <b>(香港)</b>                  | 千□      | 千□         | 千□         | 千香港・ドル      | 千円      |
| LINK REIT                    | 13.716  | 14.916     | 1,020      |             | 13,997  |
| HKT TRUST AND HKT LTD        | 22.136  | -          | -          |             | -       |
| 小計                           | □数・金額   | 35.852     | 14.916     | 1,020       | 13,997  |
|                              | 銘柄数<比率> | 2銘柄<0.1%>  | 1銘柄<0.0%>  | -           | -       |
| <b>(シンガポール)</b>              | 千□      | 千□         | 千□         | 千シンガポール・ドル  | 千円      |
| CAPITALAND MALL TRUST        | 14.7    | 13.9       | 25         |             | 1,927   |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVNT   | 25.072  | 24.272     | 71         |             | 5,414   |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 15.981  | 21.681     | 34         |             | 2,581   |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 13.1    | 13.1       | 17         |             | 1,352   |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | -       | 14.1       | 27         |             | 2,040   |
| 小計                           | □数・金額   | 68.853     | 87,053     | 176         | 13,315  |
|                              | 銘柄数<比率> | 4銘柄<0.0%>  | 5銘柄<0.0%>  | -           | -       |
| <b>(イギリス)</b>                | 千□      | 千□         | 千□         | 千イギリス・ポンド   | 千円      |
| BRITISH LAND CO PLC          | 8.045   | 8.045      | 31         |             | 4,122   |
| HAMMERSON PLC                | 4.94    | -          | -          |             | -       |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 6.057   | 6.057      | 38         |             | 5,137   |
| SEGRO PLC                    | 8.155   | 8.155      | 67         |             | 8,835   |
| 小計                           | □数・金額   | 27.197     | 22,257     | 137         | 18,095  |
|                              | 銘柄数<比率> | 4銘柄<0.1%>  | 3銘柄<0.1%>  | -           | -       |
| <b>(ユーロ…オランダ)</b>            | 千□      | 千□         | 千□         | 千ユーロ        | 千円      |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD    | 0.985   | 0.996      | 49         |             | 5,751   |
| 小計                           | □数・金額   | 0.985      | 0.996      | 49          | 5,751   |
|                              | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.1%>  | 1銘柄<0.0%>  | -           | -       |
| <b>(ユーロ…フランス)</b>            | 千□      | 千□         | 千□         | 千ユーロ        | 千円      |
| GECINA SA                    | 0.267   | 0.282      | 32         |             | 3,711   |
| ICADE                        | 0.206   | 0.206      | 13         |             | 1,589   |
| KLEPIERRE                    | 1.688   | 1.688      | 28         |             | 3,302   |
| COVIVIO                      | 0.403   | 0.403      | 21         |             | 2,457   |
| 小計                           | □数・金額   | 2.564      | 2,579      | 95          | 11,061  |
|                              | 銘柄数<比率> | 4銘柄<0.1%>  | 4銘柄<0.0%>  | -           | -       |
| 合計                           | □数・金額   | 349.083    | 381,786    | -           | 722,757 |
|                              | 銘柄数<比率> | 64銘柄<2.5%> | 67銘柄<2.4%> | -           | -       |

(注1) 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。

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## (3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別    |                       | 当 期 末 |       |
|--------|-----------------------|-------|-------|
|        |                       | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外<br>国 |                       | 百万円   | 百万円   |
|        | S&P500 EMINI FUT      | 888   | -     |
|        | S&P/TSE 60 IX FUT     | 54    | -     |
|        | SPI 200 FUTURES       | 27    | -     |
|        | FTSE 100 INDEX FUTURE | 78    | -     |
|        | DJ EURO STOXX 50      | 198   | -     |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。

## ■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

| 項 目                      | 当 期 末      |       |
|--------------------------|------------|-------|
|                          | 評 価 額      | 比 率   |
|                          | 千円         | %     |
| 株 式                      | 27,594,088 | 93.2  |
| 投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券 | 722,757    | 2.4   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等、 そ の 他   | 1,294,003  | 4.4   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額          | 29,610,849 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、29,574,742千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1香港・ドル=13.72円、1シンガポール・ドル=75.36円、1ニュージーランド・ドル=65.01円、1イギリス・ポンド=131.74円、1イスラエル・シケル=30.31円、1スイス・フラン=109.42円、1デンマーク・クローネ=15.46円、1ノルウェー・クローネ=10.41円、1スウェーデン・クローナ=10.86円、1ユーロ=115.36円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

| 項 目                | 当 期 末           |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産            | 29,609,447,809円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等    | 568,831,961     |
| 株 式(評価額)           | 27,594,088,808  |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 49,067,276      |
| 投 資 証 券(評価額)       | 673,690,177     |
| 未 収 入 金            | 68,091,874      |
| 未 収 配 当 金          | 34,165,965      |
| 差 入 委 託 証 拠 金      | 621,511,748     |
| (B) 負 債            | 13,942,000      |
| 未 払 解 約 金          | 13,942,000      |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 29,595,505,809  |
| 元 本                | 16,518,425,621  |
| 次 期 繰 越 損 益 金      | 13,077,080,188  |
| (D) 受 益 権 総 口 数    | 16,518,425,621口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 17,917円         |

(注1) 期首元本額 15,015,808,427円  
追加設定元本額 10,856,834,110円  
一部解約元本額 9,354,216,916円

(注2) 期末における元本の内訳  
動的パッケージファンド<DC年金> 3,047,212円  
コア資産形成ファンド 2,719,976円  
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ) 12,236,937,691円  
MHAM外国株式インデックスファンド 303,995,231円  
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) 21,213,198円  
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定] 557,620,659円  
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定] 3,392,891,654円  
期末元本合計 16,518,425,621円

## ■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

| 項 目                    | 当 期            |
|------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益          | 675,681,047円   |
| 受 取 配 当 金              | 671,357,017    |
| 受 取 利 息                | 1,604,501      |
| そ の 他 収 益 金            | 2,784,846      |
| 支 払 利 息                | △65,317        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益    | △3,101,557,799 |
| 売 買 益 損                | 3,135,175,559  |
| 売 買 損 益                | △6,236,733,358 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益  | △57,069,407    |
| 取 引 益 損                | 408,092,332    |
| 取 引 損 益                | △465,161,739   |
| (D) そ の 他 費 用          | △25,541,240    |
| (E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D) | △2,508,487,399 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金      | 13,675,182,281 |
| (G) 解 約 差 損 益 金        | △8,215,779,084 |
| (H) 追 加 信 託 差 損 益 金    | 10,126,164,390 |
| (I) 合 計(E+F+G+H)       | 13,077,080,188 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)       | 13,077,080,188 |

(注1) (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。

(注2) (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。

(注3) (H)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。