

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	無期限（2018年9月26日設定）	
運用方針	三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入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。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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	経費等控除後の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とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）



第2期（決算日：2020年5月20日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）」は、去る5月20日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み配分	み騰落率	(配当込み、円換算ベース)	期騰落率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2018年9月26日	10,000	—	—	798,689.85	—	—	—	—	1
1期(2019年5月20日)	9,622	0	△3.8	767,061.93	△4.0	94.3	3.1	2.5	0.962249
2期(2020年5月20日)	9,346	0	△2.9	744,889.56	△2.9	95.4	2.3	2.4	146

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) MSCIコクサイ・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、 円換算ベース)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2019年5月20日	円	%		%	%	%	%
	9,622	—	767,061.93	—	94.3	3.1	2.5
5月末	9,326	△ 3.1	743,484.51	△ 3.1	96.5	3.1	2.6
6月末	9,660	0.4	770,156.42	0.4	94.1	2.3	2.5
7月末	9,922	3.1	790,836.41	3.1	93.4	2.4	2.5
8月末	9,429	△ 2.0	751,785.28	△ 2.0	93.9	6.6	2.7
9月末	9,729	1.1	775,713.31	1.1	95.4	1.8	2.7
10月末	10,114	5.1	805,459.07	5.0	94.6	1.8	2.6
11月末	10,489	9.0	835,911.03	9.0	93.4	3.9	2.6
12月末	10,805	12.3	860,793.53	12.2	94.2	2.3	2.5
2020年1月末	10,817	12.4	861,985.05	12.4	92.7	3.9	2.6
2月末	9,964	3.6	794,123.11	3.5	93.8	3.8	2.7
3月末	8,463	△12.0	675,468.96	△11.9	102.9	6.8	2.8
4月末	9,292	△ 3.4	740,391.09	△ 3.5	90.9	3.0	2.4
(期 末) 2020年5月20日	9,346	△ 2.9	744,889.56	△ 2.9	95.4	2.3	2.4

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第2期：2019年5月21日～2020年5月20日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第2期首	9,622円
第2期末	9,346円
既払分配金	0円
騰落率	-2.9%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.9%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-2.9%）と同程度となりました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第2期：2019年5月21日～2020年5月20日

投資環境について

▶ 外国株式市況

外国株式市況はほぼ横ばいとなりました。米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇した一方で、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などを受けて下落し、外国株式市況は期を通して、ほぼ横ばいとなりました。

▶ 為替市況

米ドル、ユーロは円に対して下落しました。為替市況は、期首に比べて2.0%の円高・米ドル安、4.0%の円高・ユーロ安となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 三菱UFJ 外国株式マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ▶ **三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）**
ベンチマークとの乖離は0.0%程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。

マザーファンド保有による要因

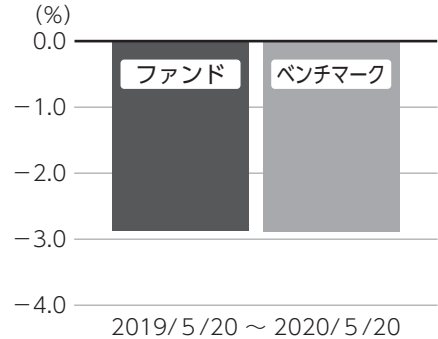
マザーファンド保有による影響は0.2%程度でした。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第2期
	2019年5月21日～2020年5月20日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	214

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

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

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ 三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ 三菱UFJ 外国株式マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2019年5月21日～2020年5月20日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	15	0.150	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(6)	(0.064)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(6)	(0.065)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.021)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.008	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(1)	(0.005)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	1	0.011	(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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(1)	(0.011)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	5	0.051	(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）	(5)	(0.048)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	22	0.220	

期中の平均基準価額は、9,776円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

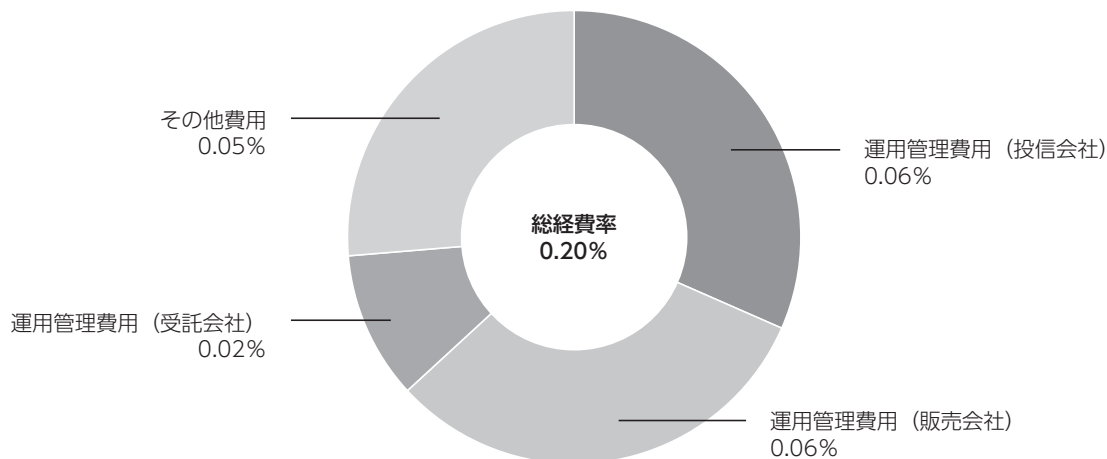
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.20%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2019年5月21日～2020年5月20日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	千口 67,803	千円 164,073	千口 5,682	千円 13,918

○株式売買比率

(2019年5月21日～2020年5月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	36,370,795千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	94,146,450千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.38

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ 外国株式マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為替直物取引	百万円 27,533	百万円 20,925	% 76.0	百万円 29,437	百万円 26,347	% 89.5

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年5月21日～2020年5月20日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 1	百万円 -	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	千口 399	千口 62,521	千円 146,368

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	千円 146,368	% 100.0
コール・ローン等、その他	64	0.0
投資信託財産総額	146,432	100.0

(注) 三菱UFJ 外国株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(94,539,008千円)の投資信託財産総額(94,629,119千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=107.98円	1 カナダドル=77.58円	1 ユーロ=118.10円	1 イギリスポンド=132.43円
1 スイスフラン=111.26円	1 スウェーデンクローネ=11.15円	1 ノルウェークローネ=10.83円	1 デンマーククローネ=15.84円
1 オーストラリアドル=70.75円	1 ニュージーランドドル=65.95円	1 香港ドル=13.93円	1 シンガポールドル=76.26円
1 イスラエルシェケル=30.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	146,432,161
コール・ローン等	63,979
三菱UFJ 外国株式マザーファンド(評価額)	146,368,182
(B) 負債	49,672
未払信託報酬	48,649
その他未払費用	1,023
(C) 純資産総額(A-B)	146,382,489
元本	156,625,313
次期繰越損益金	△ 10,242,824
(D) 受益権総口数	156,625,313口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,346円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 179,696,012円
 期中一部解約元本額 24,070,699円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9346円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は10,242,824円です。

③分配金の計算過程

項 目	2019年5月21日～ 2020年5月20日
費用控除後の配当等収益額	869,442円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	2,479,396円
分配準備積立金額	6,106円
当ファンドの分配対象収益額	3,354,944円
1万円当たり収益分配対象額	214円
1万円当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2019年5月21日～2020年5月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 24
支払利息	△ 24
(B) 有価証券売買損益	△ 2,712,277
売買益	2,017,803
売買損	△ 4,730,080
(C) 信託報酬等	△ 53,467
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	△ 2,765,768
(E) 前期繰越損益金	△ 15,931
(F) 追加信託差損益金	△ 7,461,125
(配当等相当額)	(2,260,967)
(売買損益相当額)	(△ 9,722,092)
(G) 計(D+E+F)	△10,242,824
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△10,242,824
追加信託差損益金	△ 7,461,125
(配当等相当額)	(2,479,396)
(売買損益相当額)	(△ 9,940,521)
分配準備積立金	875,548
繰越損益金	△ 3,657,247

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (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) (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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

- ①株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2019年7月1日)
- ②信託報酬率の引き下げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2019年8月20日)

三菱UFJ 外国株式マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

「三菱UFJ 外国株式マザーファンド」は、5月20日に第20期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマーク（MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに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 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資 産額
	円	%	期 騰 落 率	期 騰 落 率				
16期(2016年5月20日)	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7	114,202
17期(2017年5月22日)	20,708	20.8	663,775.10	20.5	95.7	1.7	2.5	105,751
18期(2018年5月21日)	23,482	13.4	751,162.81	13.2	95.2	2.5	2.2	106,222
19期(2019年5月20日)	24,065	2.5	767,061.93	2.1	94.3	3.1	2.5	97,464
20期(2020年5月20日)	23,411	△2.7	744,889.56	△2.9	95.4	2.3	2.4	94,605

(注) MSCIコクサイ・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。
MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、 円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2019年5月20日	円	%		%	%	%	%
5月末	24,065	—	767,061.93	—	94.3	3.1	2.5
6月末	23,325	△ 3.1	743,484.51	△ 3.1	96.6	3.1	2.6
7月末	24,164	0.4	770,156.42	0.4	94.1	2.3	2.5
8月末	24,822	3.1	790,836.41	3.1	93.5	2.4	2.5
9月末	23,591	△ 2.0	751,785.28	△ 2.0	93.9	6.6	2.7
10月末	24,347	1.2	775,713.31	1.1	95.4	1.8	2.7
11月末	25,313	5.2	805,459.07	5.0	94.6	1.8	2.6
12月末	26,255	9.1	835,911.03	9.0	93.4	3.9	2.6
2020年1月末	27,049	12.4	860,793.53	12.2	94.2	2.3	2.5
2月末	27,082	12.5	861,985.05	12.4	92.7	3.9	2.6
3月末	24,951	3.7	794,123.11	3.5	93.8	3.8	2.7
4月末	21,195	△11.9	675,468.96	△11.9	102.9	6.8	2.8
5月末	23,273	△ 3.3	740,391.09	△ 3.5	90.9	3.0	2.4
(期 末) 2020年5月20日	23,411	△ 2.7	744,889.56	△ 2.9	95.4	2.3	2.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

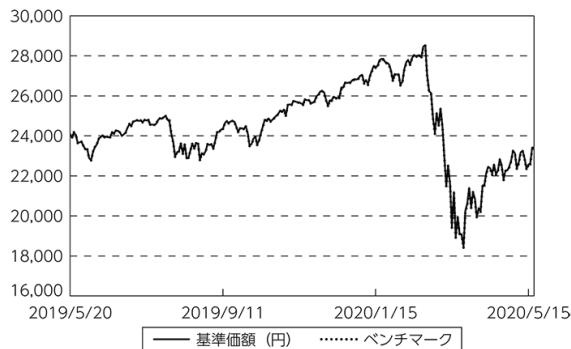
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−2.9%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 外国株式市況

- ・ 外国株式市況はほぼ横ばいとなりました。
- ・ 米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇した一方で、新型肺炎の世界的な感染拡大懸念などを受けて下落し、外国株式市況は期を通して、ほぼ横ばいとなりました。

◎ 為替市況

- ・ 米ドル、ユーロは円に対して下落しました。

● 当該投資信託の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（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

- ・ 株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは2.9%の下落となったため、乖離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。
※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(1)	(0.003)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.008	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(2)	(0.008)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.039	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(9)	(0.038)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	12	0.051	
期中の平均基準価額は、24,469円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2019年5月21日～2020年5月20日)

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	アメリカ	百株 15,327 (1,634)	千アメリカドル 117,804 (4,751)	百株 14,362 (1,084)	千アメリカドル 113,378 (8,363)
	カナダ	2,106 (Δ 129)	千カナダドル 9,315 (-)	2,885 (41)	千カナダドル 8,271 (86)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,212 (18)	4,561 (Δ 13)	1,020	4,476
	イタリア	2,543	1,102	2,567	988
	フランス	1,188 (10)	5,409 (Δ 3)	1,096	5,203
	オランダ	973	3,595	606	2,441
	スペイン	2,258 (3,904)	1,775 (83)	5,673	1,607
	ベルギー	98	614	75	450
	オーストリア	27 (-)	77 (Δ 9)	28	84
	ルクセンブルク	144	136	89	138
	フィンランド	548 (10)	529 (-)	414	493
	アイルランド	70 (0.4)	283 (2)	65 (-)	332 (2)
	ポルトガル	63	82	100	83
	イギリス	14,924 (19,610)	千イギリスポンド 8,201 (Δ 33)	12,937 (48,707)	千イギリスポンド 7,457 (125)
	スイス	853 (-)	千スイスフラン 5,785 (Δ 80)	715	千スイスフラン 5,375
	スウェーデン	1,285 (183)	千スウェーデンクローネ 16,581 (318)	1,217 (123)	千スウェーデンクローネ 16,615 (345)
	ノルウェー	275	千ノルウェークローネ 3,135	289	千ノルウェークローネ 3,834
	デンマーク	190	千デンマーククローネ 8,887	182	千デンマーククローネ 7,875
	オーストラリア	3,501 (0.17)	千オーストラリアドル 6,702 (Δ 17)	3,167 (9)	千オーストラリアドル 5,859 (1)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 332	千ニュージーランドドル 186	百株 195	千ニュージーランドドル 78
	香港	5,283 (254)	千香港ドル 18,258 (—)	5,787	千香港ドル 17,716
	シンガポール	1,195 (629)	千シンガポールドル 850 (—)	3,609	千シンガポールドル 1,016
	イスラエル	307 (12)	千イスラエルシケル 469 (—)	655	千イスラエルシケル 337

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()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。

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4	114	2	74
MACERICH CO/THE	—	—	2	75
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.804	117	0.422	65
PROLOGIS INC	3 (2)	252 (172)	2	216
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.482	24	0.505	28
DIGITAL REALTY TRUST INC	2	294	0.851	108
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2 (2)	265 (—)	0.401	27
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.566	151	0.519	148
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.381	40	0.251	27
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	87	0.813	78
WELLTOWER INC	2	182	0.83	69
BOSTON PROPERTIES INC	1	118	0.933	108
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	11	245	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.804	87	0.209	28
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	5	214	—	—
REALTY INCOME CORP	2	183	2	138
REGENCY CENTERS CORP	0.518	34	—	—
SL GREEN REALTY CORP	0.339	27	0.34	28
SUN COMMUNITIES INC	2	313	0.279	41
UDR INC	0.573	25	—	—
VENTAS INC	1	93	1	81
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3	26	3 (33)	27 (313)
WEYERHAEUSER CO	2	64	1	41
AMERICAN TOWER CORP	1	449	1	360
AGNC INVESTMENT CORP	—	—	— (12)	— (216)
WP CAREY INC	0.797	67	0.633	55
VEREIT INC	15	86	—	—
DUKE REALTY CORP	1	52	2	66
EQUINIX INC	0.496	288	0.294	172
CROWN CASTLE INTL CORP	1	270	1	217
EQUITY RESIDENTIAL	2	147	1	101
INVITATION HOMES INC	5	175	0.917	28
VICI PROPERTIES INC	10	264	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	2	50
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.383 (2)	107 (531)	0.173	50
HOST HOTELS & RESORTS INC	1	25	2	41

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.534 (△ 3)	25 (△ 172)	—	—
PUBLIC STORAGE	0.85	190	0.692	145
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	182	1	195
VORNADO REALTY TRUST	0.389	25	0.799	53
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.524	109	0.448	94
小 計	97 (3)	5,436 (531)	38 (46)	3,050 (529)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	93	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3	88	3	87
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	— (4)	— (86)	1	36
小 計	5 (4)	181 (86)	5	124
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	0.466	56	0.498	66
KLEPIERRE	0.755	22	1	56
ICADE	—	—	0.298	22
小 計	1	79	2	145
オランダ				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	100	1	101
小 計	1	100	1	101
ユ ー ロ 計	2	180	3	247
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	—	—	5	32
HAMMERSON PLC	—	—	17	49
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	2	18
小 計	—	—	25	100
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	—	—	20	54
SCENTRE GROUP	20	79	23	93
GPT GROUP	6	37	—	—
MIRVAC GROUP	12	36	15	46
STOCKLAND	9	42	—	—
DEXUS	13	172	7	94
GOODMAN GROUP	9	109	7	107
小 計	71	479	74	396
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	9	675	6	515
小 計	9	675	6	515
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
SUNTEC REIT	106 (—)	156 (△0.28038)	58	110

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST	45 (-)	111 (△0.01371)	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12 (-)	36 (△0.94123)	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	- (10)	- (-)	10	2
小計		164 (10)	303 (△ 1)	69	113

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 37,238	百万円 37,933	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(2019年5月21日～2020年5月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	36,370,795千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	94,146,450千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.38

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 27,533	百万円 20,925	% 76.0	百万円 29,437	百万円 26,347	% 89.5

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO	169	167	1,459	157,616	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	408	424	3,746	404,521	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	72	73	602	65,073	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	10	—	—	—	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	102	104	1,384	149,513	ソフトウェア・サービス
AES CORP	157	158	202	21,904	公益事業
AFLAC INC	175	184	622	67,165	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	204	208	576	62,199	保険
APACHE CORP	85	85	97	10,540	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	219	254	1,413	152,634	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	12	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	148	152	2,890	312,117	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	51	52	1,241	134,084	素材
ANTHEM INC	60	61	1,718	185,579	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	115	—	—	—	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	321	335	1,189	128,456	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	116	116	1,004	108,418	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	125	128	1,677	181,174	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	62	65	1,712	184,959	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	57	56	474	51,209	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	379	562	3,528	380,953	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	27	36	1,830	197,698	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	961	988	5,377	580,624	電気通信サービス
BALL CORP	74	75	484	52,341	素材
ALLSTATE CORP	80	77	754	81,473	保険
AVERY DENNISON CORP	21	18	188	20,337	素材
CHUBB LTD	107	108	1,109	119,756	保険
ANALOG DEVICES INC	85	88	942	101,772	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	6	5	639	69,048	小売
CVS HEALTH CORP	300	312	1,987	214,616	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	185	201	419	45,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	773	750	6,656	718,792	銀行
CATERPILLAR INC	137	132	1,487	160,574	資本財
COCA-COLA CO/THE	940	974	4,342	468,895	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	110	112	677	73,170	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	43	37	184	19,931	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	187	177	1,169	126,243	運輸
CHEVRON CORP	444	454	4,069	439,440	エネルギー
TAPESTRY INC	61	59	77	8,326	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	268	267	1,142	123,393	エネルギー
CME GROUP INC	83	86	1,548	167,201	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	70	70	365	39,417	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	191	195	1,355	146,419	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	176	197	1,556	168,028	公益事業
DEVON ENERGY CORP	112	85	104	11,313	エネルギー
DEERE & CO	71	71	970	104,836	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DANAHER CORP	146	149	2,381	257,108	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	418	432	4,948	534,382	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	28	28	215	23,226	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	166	174	1,457	157,352	公益事業
DR HORTON INC	80	86	447	48,359	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	114	122	1,503	162,338	小売
DAVITA INC	32	22	184	19,885	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	35	35	318	34,408	資本財
DTE ENERGY COMPANY	43	46	476	51,457	公益事業
EXXON MOBIL CORP	985	1,015	4,463	482,008	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	47	50	1,077	116,395	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	134	143	726	78,460	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	145	146	817	88,280	資本財
EXELON CORP	226	233	858	92,692	公益事業
ECOLAB INC	60	62	1,250	134,986	素材
EQUIFAX INC	27	28	421	45,531	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51	52	922	99,647	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	100	102	781	84,426	資本財
EDISON INTERNATIONAL	77	83	480	51,883	公益事業
ENTERGY CORP	41	51	494	53,404	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	8	9	180	19,499	保険
NEXTERA ENERGY INC	111	116	2,684	289,836	公益事業
MACY'S INC	69	—	—	—	小売
FEDEX CORP	58	59	685	74,035	運輸
FORD MOTOR CO	860	991	525	56,765	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	70	70	126	13,690	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	8	256	27,652	各種金融
FIRSTENERGY CORP	121	127	516	55,739	公益事業
FLUOR CORP	32	—	—	—	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	320	321	294	31,763	素材
GENERAL MILLS INC	142	146	888	95,964	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	58	60	829	89,573	資本財
WW GRAINGER INC	10	11	321	34,680	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,021	2,102	1,305	141,011	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	36	72	1,295	139,891	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	32	35	274	29,591	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	58	—	—	—	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	56	—	—	—	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	77	76	1,360	146,876	各種金融
HALLIBURTON CO	199	196	218	23,608	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	172	171	2,257	243,796	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	40	42	92	9,951	自動車・自動車部品
HP INC	364	368	616	66,587	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	82	88	302	32,671	保険
HERSHEY CO/THE	32	35	465	50,252	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	262	261	6,232	673,011	小売
HASBRO INC	29	29	202	21,900	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	58	56	452	48,848	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	211	212	2,550	275,429	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	92	91	292	31,540	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	69	76	1,241	134,025	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	92	92	148	16,051	メディア・娯楽

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	
IDEX CORP	17	18	282	30,536	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21	23	303	32,735	素材
JOHNSON & JOHNSON	624	631	9,407	1,015,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	23	26	379	40,979	運輸
KELLOGG CO	58	61	382	41,296	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	80	82	1,113	120,269	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	338	344	1,718	185,580	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	189	188	599	64,693	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	37	37	65	7,078	小売
ELI LILLY & CO	208	207	3,253	351,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	24	21	364	39,403	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	29	27	76	8,291	運輸
LENNAR CORP-A	67	69	403	43,603	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	187	185	2,162	233,538	小売
LEGGETT & PLATT INC	27	27	78	8,487	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	59	—	—	—	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	89	82	395	42,743	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	59	60	2,251	243,121	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	50	51	180	19,466	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	8	8	154	16,676	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	17	—	—	—	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	67	68	617	66,683	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	179	180	3,245	350,454	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	58	58	1,824	196,980	各種金融
MEDTRONIC PLC	312	321	3,115	336,436	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	605	611	4,739	511,725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	263	265	1,199	129,479	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	79	—	—	—	耐久消費財・アパレル
3M CO	135	138	2,048	221,200	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	38	41	566	61,139	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	113	112	170	18,409	消費者サービス
MASCO CORP	68	70	319	34,471	資本財
M & T BANK CORP	31	33	306	33,142	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	117	120	1,270	137,163	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	15	13	114	12,364	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	299	289	1,137	122,776	各種金融
MCKESSON CORP	46	39	564	60,906	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	194	183	595	64,280	保険
MANPOWERGROUP INC	16	13	90	9,821	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	40	40	1,023	110,550	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	63	62	1,046	113,022	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,168	2,047	4,546	490,945	銀行
NISOURCE INC	83	93	214	23,164	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	38	38	1,256	135,671	資本財
NEWMONT CORP	191	195	1,317	142,312	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	27	29	508	54,861	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	3	3	280	30,256	保険
NUCOR CORP	72	74	302	32,612	素材
NEWELL BRANDS INC	115	85	107	11,639	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	109	102	94	10,169	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	175	210	301	32,605	エネルギー
OMNICOM GROUP	52	53	277	29,959	メディア・娯楽

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	
PEPSICO INC	328	333	4,398	474,960	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	23	20	186	20,135	素材
ALTRIA GROUP INC	436	449	1,667	180,037	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	27	27	198	21,469	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	579	597	6,722	725,878	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	107	104	1,057	114,212	銀行
PFIZER INC	1,345	1,328	5,006	540,561	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	95	98	542	58,565	保険
PULTEGROUP INC	56	63	198	21,414	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	31	30	498	53,859	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	39	46	414	44,810	エネルギー
CITIGROUP INC	568	524	2,328	251,444	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	67	61	217	23,460	保険
PPG INDUSTRIES INC	55	55	521	56,288	素材
PENTAIR PLC	42	34	119	12,949	資本財
PPL CORP	162	172	437	47,201	公益事業
PROGRESSIVE CORP	135	140	1,063	114,808	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	115	120	582	62,896	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	39	40	171	18,473	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	66	—	—	—	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	54	58	474	51,233	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	237	214	206	22,325	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	10	170	18,384	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	24	891	96,226	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	115	111	190	20,587	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	29	24	117	12,675	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	28	568	61,439	資本財
SCHLUMBERGER LTD	322	375	642	69,387	エネルギー
STRYKER CORP	78	81	1,531	165,411	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	281	275	909	98,225	各種金融
SEMPRA ENERGY	63	67	847	91,501	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19	19	1,116	120,588	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	35	40	488	52,791	資本財
SUNTRUST BANKS INC	103	—	—	—	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	60	64	602	65,020	保険
SOUTHERN CO/THE	239	250	1,339	144,612	公益事業
AT&T INC	1,692	1,751	5,071	547,570	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	64	71	297	32,076	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	86	88	500	54,019	各種金融
SYSCO CORP	113	117	604	65,244	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	37	37	113	12,230	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	223	224	2,534	273,664	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	26	25	328	35,474	小売
TERADYNE INC	—	39	243	26,240	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	26	23	168	18,144	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	213	186	540	58,310	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	93	96	3,298	356,179	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	54	54	145	15,720	資本財
UNION PACIFIC CORP	171	166	2,652	286,448	運輸
UNUM GROUP	46	46	67	7,323	保険
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	190	362	2,101	226,911	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	223	227	6,570	709,502	ヘルスケア機器・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	
US BANCORP	358	356	1,141	123,227	銀行
MARATHON OIL CORP	199	170	99	10,694	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	161	168	1,624	175,461	運輸
VALERO ENERGY CORP	97	97	627	67,722	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	19	22	259	28,045	ヘルスケア機器・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	79	145	286	30,939	メディア・娯楽
VF CORP	77	80	441	47,621	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	31	31	313	33,811	素材
WILLIAMS COS INC	281	314	610	65,935	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	187	179	715	77,281	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	75	74	649	70,131	公益事業
WALMART INC	338	340	4,253	459,271	食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC	11	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	1,040	961	2,303	248,722	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	99	100	992	107,132	商業・専門サービス
WATERS CORP	18	16	296	31,966	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	15	13	163	17,616	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	45	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	123	126	753	81,353	公益事業
KEYCORP	246	229	234	25,279	銀行
CARMAX INC	39	41	325	35,106	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	48	48	599	64,698	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	74	76	667	72,078	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	288	292	1,468	158,573	小売
CLOROX COMPANY	30	29	601	64,974	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	31	27	227	24,572	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	67	66	571	61,674	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	98	93	131	14,224	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	76	147	2,002	216,257	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	108	117	388	41,969	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	70	81	574	62,017	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	178	193	329	35,551	銀行
INTEL CORP	1,061	1,044	6,295	679,786	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,047	1,017	4,540	490,280	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	21	21	507	54,809	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	26	—	—	—	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	102	105	3,220	347,754	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	227	221	1,230	132,826	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	70	68	817	88,281	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	69	69	404	43,664	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC	155	147	297	32,152	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	85	90	814	87,968	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	54	57	504	54,429	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	296	299	2,741	296,062	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP	—	36	305	32,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	148	142	3,242	350,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	38	32	105	11,445	銀行
NORTHERN TRUST CORP	50	47	350	37,869	各種金融
MICROSOFT CORP	1,696	1,737	31,909	3,445,595	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	19	20	533	57,605	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	98	141	947	102,312	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	288	284	2,156	232,831	消費者サービス

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	
ORACLE CORP	617	550	2,882	311,277	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	101	105	4,745	512,456	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18	18	761	82,212	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	167	184	1,347	145,539	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	42	41	461	49,840	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	33	31	181	19,552	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	27	26	287	31,030	小売
LAM RESEARCH CORP	36	34	904	97,617	半導体・半導体製造装置
COPART INC	51	49	417	45,041	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	20	241	26,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	22	20	172	18,592	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,055	1,088	4,160	449,258	メディア・娯楽
XILINX INC	58	60	523	56,551	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	82	81	560	60,548	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	49	63	262	28,313	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	17	18	408	44,069	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	300	304	2,200	237,611	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	30	30	414	44,790	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	26	27	1,482	160,085	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	57	62	1,797	194,077	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	12	12	232	25,093	銀行
PAYCHEX INC	77	83	546	59,012	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	104	88	136	14,783	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	14	12	116	12,628	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	30	32	340	36,750	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13	20	318	34,340	運輸
AUTODESK INC	50	53	1,037	111,978	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	47	37	81	8,784	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	177	200	3,525	380,632	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	28	—	—	—	小売
ALPHABET INC-CL A	69	71	9,879	1,066,754	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	12	302	32,624	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EAST WEST BANCORP INC	34	34	113	12,229	銀行
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	9	440	47,540	各種金融
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	28	32	262	28,386	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	60	54	212	22,939	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	281	274	2,142	231,344	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	67	59	313	33,878	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSIS INC	34	35	577	62,369	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	65	360	38,911	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	96	101	24,757	2,673,350	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	54	58	670	72,390	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	29	29	329	35,585	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	37	37	643	69,503	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	57	50	121	13,154	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	58	49	200	21,691	各種金融
CERNER CORP	70	74	507	54,752	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	40	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	25	25	536	57,959	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	61	64	595	64,250	商業・専門サービス
EBAY INC	212	183	779	84,191	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
IAC/INTERACTIVECORP	17	19	496	53,639	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	134	139	4,918	531,126	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	56	55	443	47,937	小売
BOOKING HOLDINGS INC	10	10	1,567	169,277	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	301	314	5,422	585,491	各種金融
TRUIST FINANCIAL CORP	178	322	1,044	112,783	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	230	207	695	75,097	各種金融
BORGWARNER INC	50	44	127	13,772	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	43	—	—	—	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	25	27	304	32,860	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	35	37	336	36,312	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	12	13	128	13,870	保険
AMEREN CORPORATION	56	63	446	48,168	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	114	118	911	98,413	公益事業
AON PLC	56	—	—	—	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	130	141	492	53,190	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	64	60	277	29,964	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	74	73	170	18,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	66	66	226	24,426	各種金融
RED HAT INC	40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	14	13	185	19,997	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	55	55	147	15,964	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	36	39	385	41,679	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	59	54	242	26,235	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	40	44	420	45,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	138	152	416	44,928	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	46	43	1,350	145,782	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	34	35	1,216	131,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	113	116	4,326	467,170	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	59	62	1,757	189,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	223	251	302	32,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELGENE CORP	162	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	134	133	687	74,249	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	39	39	282	30,543	運輸
FASTENAL CO	66	135	522	56,418	資本財
FISERV INC	91	138	1,423	153,759	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	126	105	105	11,348	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEKTAR THERAPEUTICS	41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	391	338	184	19,916	メディア・娯楽
APPLE INC	1,103	1,065	33,370	3,603,334	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	37	41	218	23,573	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	241	250	197	21,279	銀行
ZIONS BANCORP NA	42	43	125	13,598	銀行
COSTAR GROUP INC	8	9	621	67,094	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	50	52	535	57,851	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	34	29	225	24,327	運輸
CENTURYLINK INC	213	239	229	24,746	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	31	31	142	15,395	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	115	123	198	21,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	94	97	343	37,047	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	64	56	282	30,478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	29	34	120	13,011	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ADVANCE AUTO PARTS INC	16	16	225	24,389	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	93	83	100	10,819	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	38	40	687	74,282	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.75	0.98	307	33,196	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	11	11	356	38,466	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	68	74	666	72,000	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	34	34	175	18,957	保険
DISCOVERY INC - A	31	29	61	6,625	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	99	95	638	68,904	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	28	33	258	27,906	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	56	47	130	14,066	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	119	103	217	23,471	メディア・娯楽
AMERIPRISE FINANCIAL INC	32	30	396	42,777	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	61	58	159	17,207	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	132	133	1,239	133,824	各種金融
NASDAQ INC	27	28	315	34,101	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	41	41	32	3,503	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	36	32	146	15,823	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B	76	—	—	—	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	21	17	113	12,281	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	74	75	287	31,000	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5	6	630	68,100	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	62	72	489	52,820	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC-SERIES A	94	—	—	—	小売
ARROW ELECTRONICS INC	17	17	113	12,259	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	—	56	17	23,272	保険
CUMMINS INC	34	35	555	60,025	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	27	29	219	23,749	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	57	57	75	8,150	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13	14	258	27,923	素材
CIMAREX ENERGY CO	22	—	—	—	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	11	11	81	8,802	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	52	60	281	30,409	公益事業
HANESBRANDS INC	88	88	81	8,835	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	213	215	6,259	675,923	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	112	99	186	20,188	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	34	32	321	34,750	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	25	26	73	7,973	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	25	21	43	4,691	資本財
IPG PHOTONICS CORP	9	7	117	12,734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	80	81	90	9,755	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	60	47	73	7,933	消費者サービス
HEICO CORP	—	10	89	9,671	資本財
TRANSIGM GROUP INC	10	11	405	43,838	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	28	28	342	37,029	ソフトウェア・サービス
INSULET CORP	—	13	272	29,430	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	31	30	612	66,107	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	91	118	130	14,111	銀行
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	159	841	90,828	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	81	84	646	69,773	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	77	86	341	36,917	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	22	26	659	71,180	耐久消費財・アパレル

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	
WABCO HOLDINGS INC	10	10	146	15,794	資本財
MERCADOLIBRE INC	9	10	863	93,206	小売
VMWARE INC-CLASS A	18	17	247	26,700	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	61	64	200	21,659	保険
SEATTLE GENETICS INC	28	28	452	48,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	13	13	281	30,372	小売
LKQ CORP	69	68	170	18,427	小売
HORMEL FOODS CORP	69	68	323	34,980	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	50	199	21,576	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO	31	31	197	21,359	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	27	52	947	102,308	資本財
HUMANA INC	31	31	1,252	135,238	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	68	54	193	20,864	公益事業
INVESCO LTD	100	83	60	6,545	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	40	43	404	43,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	26	134	14,520	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	47	44	255	27,535	エネルギー
MSCI INC	20	21	712	76,938	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	—	—	—	エネルギー
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	42	46	175	19,002	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	361	373	2,556	276,001	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	409	410	7,771	839,210	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	97	97	177	19,136	エネルギー
FLOWERVE CORP	26	32	78	8,428	資本財
HELMERICH & PAYNE	22	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	80	102	1,009	108,991	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	71	85	163	17,692	メディア・娯楽
RESMED INC	34	35	576	62,230	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	20	21	242	26,180	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	55	60	505	54,609	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	90	97	236	25,520	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	55	59	427	46,142	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	18	191	20,700	運輸
PERRIGO CO PLC	31	31	170	18,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	32	32	288	31,200	素材
WABTEC CORP	31	44	246	26,645	資本財
EVERSOURCE ENERGY	74	78	613	66,277	公益事業
INGREDION INC	17	14	112	12,094	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	78	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	32	32	205	22,154	素材
EATON VANCE CORP	30	29	102	11,112	各種金融
DELTA AIR LINES INC	36	41	91	9,861	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	41	45	551	59,559	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	36	37	586	63,319	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	60	61	1,117	120,614	小売
FORTINET INC	35	34	503	54,372	ソフトウェア・サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	14	—	—	—	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5	5	416	44,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	21	—	—	—	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	6	—	—	—	運輸
GENERAL MOTORS CO	296	307	759	82,017	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NXP SEMICONDUCTORS NV	79	69	683	73,801	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	76	64	375	40,500	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	10	9	157	16,992	資本財
HCA HEALTHCARE INC	63	64	670	72,436	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	36	31	93	10,128	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	161	158	546	59,038	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	28	29	287	31,039	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	29	34	205	22,160	資本財
DEXCOM INC	21	22	899	97,112	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	13	13	84	9,130	資本財
XYLEM INC	41	41	252	27,220	資本財
ABIOMED INC	9	10	199	21,507	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	25	25	47	5,103	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12	12	141	15,291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	37	40	395	42,739	銀行
ALLEGHANY CORP	3	3	155	16,777	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	18	19	1,088	117,589	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	102	108	818	88,410	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	558	577	12,527	1,352,687	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	66	69	381	41,209	公益事業
ALBEMARLE CORP	24	24	156	16,897	素材
PVH CORP	18	15	62	6,795	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	475	489	751	81,146	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	75	86	115	12,419	商業・専門サービス
APTIV PLC	59	61	431	46,629	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	36	36	131	14,211	資本財
SPLUNK INC	34	39	622	67,241	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A	—	19	143	15,503	資本財
OGE ENERGY CORP	51	45	137	14,855	公益事業
POLARIS INC	13	13	110	11,891	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	349	423	3,859	416,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	8	278	30,124	資本財
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	15	230	24,926	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	29	32	2,628	283,820	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	52	51	220	23,760	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29	29	184	19,880	各種金融
ZOETIS INC	111	114	1,540	166,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	17	361	39,088	ヘルスケア機器・サービス
NEWS CORP - CLASS A	102	103	115	12,443	メディア・娯楽
SPRINT CORP	155	—	—	—	電気通信サービス
SNAP-ON INC	13	12	159	17,259	資本財
PERKINELMER INC	—	25	234	25,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAPRI HOLDINGS LTD	35	35	47	5,126	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	159	175	525	56,769	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	17	18	354	38,296	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	69	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	34	39	625	67,499	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	41	45	1,737	187,616	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	18	20	202	21,879	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	20	20	475	51,316	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	20	23	216	23,417	資本財
ALPHABET INC-CL C	73	74	10,189	1,100,303	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
UNITED RENTALS INC	18	18	224	24,273	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	29	—	—	—	運輸
VOYA FINANCIAL INC	39	34	142	15,413	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	9	9	39	4,228	素材
IQVIA HOLDINGS INC	36	42	597	64,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	94	81	130	14,041	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	63	69	526	56,819	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	30	25	97	10,581	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	35	33	138	14,976	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	42	46	445	48,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	26	25	326	35,206	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	24	27	389	42,037	メディア・娯楽
OWENS CORNING	28	22	99	10,726	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	51	47	58	6,333	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	21	23	542	58,547	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	153	138	244	26,444	各種金融
QORVO INC	29	25	253	27,372	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	30	163	17,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	44	44	398	43,039	保険
ACUITY BRANDS INC	9	9	79	8,592	資本財
JONES LANG LASALLE INC	9	11	109	11,806	不動産
ARAMARK	59	53	132	14,355	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	111	104	216	23,401	銀行
LEAR CORP	14	14	152	16,452	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	22	27	393	42,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	43	55	115	12,492	素材
TARGA RESOURCES CORP	58	51	86	9,288	エネルギー
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	8	82	8,859	ソフトウェア・サービス
GRUBHUB INC	22	22	128	13,828	小売
CHEMOURS CO/THE	42	—	—	—	素材
WESTROCK CO	62	54	136	14,748	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	144	159	477	51,565	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	260	267	3,891	420,236	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	—	12	275	29,723	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	11	316	34,157	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	17	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	28	28	145	15,667	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	332	314	315	34,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	1	1	56	6,048	運輸
CDW CORP/DE	36	34	367	39,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	68	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	123	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	11	12	284	30,682	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	40	40	244	26,348	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	41	44	349	37,787	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	40	40	300	32,458	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	—	13	112	12,190	メディア・娯楽
WAYFAIR INC- CLASS A	14	14	225	24,397	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	48	48	34	3,684	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	41	41	136	14,774	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP -RIGHT	—	5	4	459	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	15	16	54	5,921	メディア・娯楽

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	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	50	51	167	18,116	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	8	10	189	20,419	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	5	237	25,688	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	8	9	343	37,116	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	37	36	1,876	202,646	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	20	20	594	64,151	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	34	28	120	12,996	資本財
UGI CORP	40	44	135	14,580	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	49	50	182	19,753	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	70	74	440	47,583	資本財
IHS MARKIT LTD	92	93	630	68,099	商業・専門サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	54	57	321	34,700	ソフトウェア・サービス
COTY INC-CL A	126	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	18	182	19,692	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC	108	86	104	11,252	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	36	35	195	21,141	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	58	—	—	—	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	13	13	117	12,656	保険
TELEFLEX INC	10	11	389	42,026	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	50	—	—	—	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR	8	8	135	14,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECHNIPFMC PLC	91	89	62	6,729	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	29	31	608	65,685	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A	—	27	510	55,104	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	26	26	262	28,343	各種金融
SNAP INC - A	—	184	321	34,754	メディア・娯楽
DXC TECHNOLOGY CO	66	62	100	10,825	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	39	30	80	8,701	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	18	18	102	11,042	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	44	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	38	34	102	11,089	資本財
ROLLINS INC	33	33	132	14,315	商業・専門サービス
XPO LOGISTICS INC	29	21	144	15,597	運輸
BAKER HUGHES CO	125	160	233	25,186	エネルギー
OKTA INC	—	25	468	50,636	ソフトウェア・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	20	—	—	—	保険
DUPONT DE NEMOURS INC	532	178	853	92,134	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	25	26	103	11,195	運輸
BLACK KNIGHT INC	—	34	257	27,855	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	70	85	673	72,772	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	71	84	165	17,899	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	—	86	245	26,539	資本財
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	8	316	34,214	ソフトウェア・サービス
PTC INC	24	26	185	20,030	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	96	95	2,596	280,319	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	62	56	325	35,170	公益事業
ALTICE USA INC- A	79	34	84	9,112	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	5	100	10,890	保険
DOCUSIGN INC	—	23	300	32,488	ソフトウェア・サービス
LINDE PLC	128	129	2,458	265,438	素材
WIX.COM LTD	11	11	210	22,767	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	57	97	167	18,087	各種金融

銘柄	株数	当期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
BURLINGTON STORES INC	16	15	271	29,363	小売	
KKR & CO INC	104	119	308	33,350	各種金融	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	67	89	173	18,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CIGNA CORP	88	90	1,729	186,706	ヘルスケア機器・サービス	
DELL TECHNOLOGIES -C	34	33	148	16,011	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MONGODB INC	—	10	213	23,089	ソフトウェア・サービス	
FOX CORP - CLASS A	76	84	231	25,033	メディア・娯楽	
FOX CORP - CLASS B	35	46	124	13,439	メディア・娯楽	
DOW INC	177	181	647	69,921	素材	
DROPBOX INC-CLASS A	—	48	104	11,280	ソフトウェア・サービス	
STERIS PLC	—	19	307	33,194	ヘルスケア機器・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	—	104	348	37,619	運輸	
CORTEVA INC	—	192	460	49,746	素材	
AMCOR PLC	—	382	359	38,861	素材	
XEROX HOLDINGS CORP	—	45	79	8,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROKU INC	—	22	262	28,375	メディア・娯楽	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	32	234	25,343	ソフトウェア・サービス	
PINTEREST INC- CLASS A	—	65	122	13,266	メディア・娯楽	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	17	473	51,124	ソフトウェア・サービス	
RPM INTERNATIONAL INC	—	30	210	22,689	素材	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	338	211	22,788	各種金融	
AGNC INVESTMENT CORP	—	124	161	17,491	各種金融	
AON PLC	—	55	1,084	117,142	保険	
OTIS WORLDWIDE CORP	—	93	489	52,869	資本財	
CARRIER GLOBAL CORP	—	187	332	35,920	資本財	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	280	280	109	11,821	不動産	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	53	53	113	12,229	資本財	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	51	51	223	24,170	資本財	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	80	80	37	4,085	食品・生活必需品小売り	
小計	株数	金額	70,489	72,003	598,708	64,648,535
銘柄数 < 比率 >	598	602	—	—	—	< 68.3% >
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	336	342	2,863	222,155	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	69	60	125	9,700	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	44	44	418	32,457	商業・専門サービス	
TC ENERGY CORP	215	224	1,374	106,665	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	82	94	521	40,473	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	135	154	709	55,065	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	114	113	152	11,808	素材	
BARRICK GOLD CORP	408	424	1,660	128,812	素材	
BCE INC	33	33	182	14,162	電気通信サービス	
BOMBARDIER INC-B	530	—	—	—	資本財	
BANK OF MONTREAL	150	160	1,043	80,956	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	195	305	1,272	98,751	各種金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	286	292	1,491	115,713	銀行	
BAUSCH HEALTH COS INC	76	67	167	12,989	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	60	60	124	9,635	資本財	
CAMECO CORP	106	75	102	7,948	エネルギー	
CI FINANCIAL CORP	44	45	67	5,264	各種金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	102	108	884	68,595	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	278	301	754	58,519	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	170	172	1,950	151,291	運輸	

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	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	13	13	126	9,833	小売
ENBRIDGE INC	472	489	2,185	169,576	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	6	221	17,147	保険
CGI INC	59	60	509	39,514	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	91	—	—	—	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	23	23	67	5,254	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	41	44	302	23,450	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	459	470	747	57,975	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	73	66	352	27,311	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	78	80	427	33,185	銀行
ONEX CORPORATION	17	21	131	10,231	各種金融
POWER CORP OF CANADA	70	138	290	22,525	保険
POWER FINANCIAL CORP	58	—	—	—	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	112	112	251	19,541	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC	371	380	910	70,664	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	16	16	166	12,952	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	34	1,098	85,185	運輸
ENCANA CORP	330	—	—	—	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	57	58	549	42,638	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	46	—	—	—	資本財
KINROSS GOLD CORP	232	328	345	26,794	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	45	—	—	—	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	70	56	113	8,841	保険
METHANEX CORP	13	13	30	2,362	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	281	—	—	—	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	44	42	77	5,979	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	49	57	196	15,242	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	131	131	82	6,372	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	57	114	258	20,049	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	163	163	136	10,571	素材
FORTIS INC	98	104	536	41,632	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	102	220	905	70,284	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	162	162	107	8,357	素材
TORONTO-DOMINION BANK	427	431	2,419	187,715	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	45	46	953	73,985	素材
WHEATON PRECIIOUS METALS CORP	97	109	708	54,999	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	37	37	114	8,918	食品・生活必需品小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	34	34	106	8,224	公益事業
METRO INC/CN	60	69	408	31,700	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	65	67	370	28,780	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	31	34	452	35,071	保険
CENOVUS ENERGY INC	254	224	125	9,731	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	96	—	—	—	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	62	—	—	—	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	117	125	439	34,069	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	26	—	—	—	エネルギー
DOLLARAMA INC	70	70	305	23,677	小売
KEYERA CORP	51	51	111	8,649	エネルギー
ALTAGAS LTD	63	63	98	7,605	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	21	14	50	3,953	公益事業
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	41	—	—	—	不動産
INTER PIPELINE LTD	98	98	117	9,131	エネルギー

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	58	36	35	2,730		エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	68	—	—	—		エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	5	744	57,773		ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	56	70	514	39,944		消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9	15	58	4,525		素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	37	31	129	10,079		素材
HYDRO ONE LTD	65	80	204	15,869		公益事業
EMERA INC	17	58	309	24,019		公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A	21	25	2,623	203,517		ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	141	142	641	49,745		素材
WSP GLOBAL INC	24	24	212	16,479		資本財
AURORA CANNABIS INC	163	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANOPY GROWTH CORP	49	49	117	9,138		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARS GROUP INC/THE	43	47	176	13,669		消費者サービス
IA FINANCIAL CORP INC	20	22	87	6,789		保険
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	60	338	26,225		素材
CRONOS GROUP INC	44	44	34	2,672		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUEBECOR INC -CL B	—	40	115	8,943		メディア・娯楽
AIR CANADA	—	30	50	3,893		運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	116	222	17,251		公益事業
PARKLAND FUEL CORP	—	33	120	9,316		エネルギー
小計	株数・金額	9,825	8,875	40,516	3,143,243	
	銘柄数<比率>	88	80	—	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
COMMERZBANK AG	217	253	83	9,807		銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	456	522	344	40,637		各種金融
SIEMENS AG-REG	177	184	1,714	202,424		資本財
RWE AG	114	139	394	46,556		公益事業
BASF SE	213	220	1,009	119,168		素材
VOLKSWAGEN AG	6	6	88	10,395		自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	211	219	680	80,359		自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	41	47	369	43,601		家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	496	559	527	62,261		公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	75	79	396	46,808		自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	216	236	1,430	168,979		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG	98	99	1,565	184,843		保険
CONTINENTAL AG	25	25	208	24,659		自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	258	294	547	64,642		半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	37	37	173	20,434		自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	58	58	47	5,585		運輸
HUGO BOSS AG -ORD	16	—	—	—		耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	227	243	675	79,739		運輸
SAP SE	228	235	2,542	300,278		ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	62	—	—	—		メディア・娯楽
DEUTSCHE BOERSE AG	44	47	721	85,175		各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	50	51	377	44,616		ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	9	37	4,443		運輸
ADIDAS AG	42	43	946	111,839		耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	776	795	1,085	128,226		電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	34	34	643	76,008		保険
THYSSENKRUPP AG	109	91	47	5,601		素材
BEIERSDORF AG	23	23	222	26,312		家庭用品・パーソナル用品

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEIDELBERGCEMENT AG	33	37	157	18,546	素材	
MERCK KGAA	28	30	319	37,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	43	45	607	71,695	自動車・自動車部品	
PUMA SE	2	17	106	12,540	耐久消費財・アパレル	
LANXESS AG	21	21	98	11,623	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	94	98	411	48,558	ヘルスケア機器・サービス	
HOCHTIEF AG	5	5	38	4,496	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	80	85	328	38,812	不動産	
GEA GROUP AG	36	36	93	11,005	資本財	
SYMRISE AG	29	29	284	33,551	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	22	23	164	19,471	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	29	20	76	9,089	電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	13	13	55	6,583	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	14	14	198	23,389	保険	
BRENNTAG AG	36	36	163	19,282	資本財	
AXEL SPRINGER SE	13	—	—	—	メディア・娯楽	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	9	85	10,126	ヘルスケア機器・サービス	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	14	14	50	5,914	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	199	199	55	6,578	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	20	—	—	—	資本財	
VONOVIA SE	117	129	634	74,922	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	41	54	120	14,232	素材	
ZALANDO SE	24	30	166	19,611	小売	
COVESTRO AG	41	41	126	14,974	素材	
UNIPER SE	50	42	108	12,804	公益事業	
INNOGY SE	32	—	—	—	公益事業	
METRO AG	48	48	39	4,654	食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	18	14	65	7,781	資本財	
I&I DRILLISCH AG	12	—	—	—	電気通信サービス	
MTU AERO ENGINES AG	11	15	205	24,318	資本財	
WIRECARD AG	26	27	229	27,088	ソフトウェア・サービス	
DELIVERY HERO SE	22	24	203	24,078	小売	
SARTORIUS AG-VORZUG	8	8	259	30,637	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	37	32	142	16,781	ヘルスケア機器・サービス	
KNORR-BREMSE AG	—	11	98	11,637	資本財	
小 計	株数・金額	5,573	5,783	22,573	2,665,983	
	銘柄数<比率>	61	57	—	<2.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	271	248	303	35,860	保険	
INTESA SANPAOLO	3,467	3,511	502	59,339	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	2,968	2,070	71	8,491	電気通信サービス	
ENI SPA	597	623	523	61,775	エネルギー	
UNICREDIT SPA	457	528	343	40,530	銀行	
ENEL SPA	1,909	1,942	1,172	138,529	公益事業	
RECORDATI SPA	22	22	93	10,995	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	117	105	142	16,872	運輸	
MEDIOBANCA SPA	154	154	78	9,328	銀行	
SNAM SPA	553	581	232	27,496	公益事業	
TELECOM ITALIA-RSP	871	1,411	49	5,844	電気通信サービス	
LEONARDO SPA	89	89	48	5,710	資本財	
TERNA SPA	312	343	188	22,311	公益事業	
PRYSMIAN SPA	45	58	105	12,414	資本財	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	148	139	94	11,142	食品・飲料・タバコ	
POSTE ITALIANE SPA	113	116	86	10,162	保険	
FINCOBANK SPA	—	128	126	14,922	銀行	
MONCLER SPA	44	43	139	16,463	耐久消費財・アパレル	
PIRELLI & C SPA	94	94	32	3,831	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,238	12,215	4,335	512,025	
	銘柄 数 < 比 率 >	18	19	—	< 0.5% >	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	39	40	355	41,978	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	64	66	2,384	281,654	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	138	141	164	19,415	自動車・自動車部品	
AXA SA	451	455	714	84,355	保険	
DANONE	143	147	909	107,418	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	127	140	175	20,728	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	238	198	388	45,877	メディア・娯楽	
INGENICO GROUP	15	12	156	18,492	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	182	189	234	27,648	銀行	
ATR LIQUIDE SA	99	112	1,307	154,456	素材	
TOTAL SA	562	577	1,903	224,750	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	115	117	292	34,559	資本財	
VINCI SA	118	123	959	113,371	資本財	
SANOFI	262	270	2,349	277,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	122	123	225	26,663	公益事業	
L'OREAL	58	60	1,490	176,033	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	44	36	78	9,268	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	127	131	1,091	128,952	資本財	
BNP PARIBAS	261	265	751	88,742	銀行	
ESSILORLUXOTTICA	65	67	760	89,775	耐久消費財・アパレル	
CAPGEMINI SE	37	38	332	39,259	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	14	14	45	5,423	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	54	54	101	11,968	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	7	7	547	64,620	耐久消費財・アパレル	
SODEXO SA	19	28	160	18,896	消費者サービス	
KERING	17	18	793	93,753	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	30	33	463	54,781	ソフトウェア・サービス	
ATOS SE	23	23	147	17,474	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	457	499	507	59,962	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	36	36	33	3,928	保険	
IMERYS SA	9	—	—	—	素材	
SAFRAN SA	77	76	604	71,339	資本財	
RENAULT SA	42	40	68	8,132	自動車・自動車部品	
PUBLICIS GROUPE	46	56	140	16,548	メディア・娯楽	
JCDECAUX SA	20	20	37	4,394	メディア・娯楽	
SOCIETE BIC SA	7	—	—	—	商業・専門サービス	
BOUYGUES SA	52	52	133	15,806	資本財	
THALES SA	23	24	158	18,665	資本財	
PERNOD RICARD SA	48	51	679	80,243	食品・飲料・タバコ	
CREDIT AGRICOLE SA	258	255	179	21,221	銀行	
ENGIE	415	430	419	49,505	公益事業	
ALSTOM	39	47	182	21,497	資本財	
ARKEMA	14	17	131	15,577	素材	
LEGRAND SA	61	70	405	47,904	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等		
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円			
SCOR SE	40	32	76	9,019	保険		
ADP	6	6	54	6,414	運輸		
EDF	151	130	96	11,370	公益事業		
NATIXIS	225	225	43	5,165	各種金融		
WENDEL	6	6	51	6,090	各種金融		
BUREAU VERITAS SA	54	66	123	14,570	商業・専門サービス		
EURAZEO SE	13	9	38	4,572	各種金融		
SUEZ	88	71	67	7,928	公益事業		
EIFFAGE	19	24	184	21,847	資本財		
ILIAD SA	7	5	72	8,534	電気通信サービス		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	30	44	40	4,742	メディア・娯楽		
BIOMERIEUX	10	10	129	15,298	ヘルスケア機器・サービス		
GETLINK SE	95	91	102	12,061	運輸		
EDENRED	51	59	208	24,644	ソフトウェア・サービス		
REMY COINTREAU	5	5	60	7,197	食品・飲料・タバコ		
REXEL SA	66	—	—	—	資本財		
BOLLORE	169	225	56	6,636	メディア・娯楽		
DASSAULT AVIATION SA	0.63	0.63	43	5,137	資本財		
SEB SA	5	6	65	7,769	耐久消費財・アパレル		
IPSEN	8	8	56	6,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
AMUNDI SA	15	15	91	10,854	各種金融		
FAURECIA	18	18	60	7,161	自動車・自動車部品		
TELEPERFORMANCE	12	13	295	34,855	商業・専門サービス		
UBISOFT ENTERTAINMENT	20	20	137	16,182	メディア・娯楽		
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	7	7	157	18,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
WORLDLINE SA	19	28	180	21,369	ソフトウェア・サービス		
小 計	株 数	金 額	6,210	6,312	25,463	3,007,204	
	銘柄 数 < 比 率 >		70	67	—	< 3.2% >	
(ユーロ…オランダ)							
QIAGEN N.V.	49	56	221	26,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CNH INDUSTRIAL NV	248	252	130	15,395	資本財		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	247	245	182	21,537	自動車・自動車部品		
FERRARI NV	28	28	418	49,451	自動車・自動車部品		
EXOR NV	25	25	116	13,720	各種金融		
AIRBUS SE	135	137	748	88,370	資本財		
STMICROELECTRONICS NV	161	164	366	43,254	半導体・半導体製造装置		
WOLTERS KLUWER	67	66	442	52,217	商業・専門サービス		
UNILEVER NV	—	352	1,563	184,619	家庭用品・パーソナル用品		
KONINKLIJKE KPN NV	834	834	173	20,473	電気通信サービス		
AKZO NOBEL N.V.	52	46	332	39,320	素材		
HEINEKEN NV	58	61	465	54,921	食品・飲料・タバコ		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	214	218	870	102,816	ヘルスケア機器・サービス		
AEGON NV	436	372	84	9,998	保険		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	269	276	622	73,468	食品・生活必需品小売り		
RANDSTAD NV	27	27	102	12,054	商業・専門サービス		
HEINEKEN HOLDING NV	27	25	174	20,619	食品・飲料・タバコ		
KONINKLIJKE DSM NV	41	42	475	56,109	素材		
ING GROEP NV	904	1,002	520	61,474	銀行		
ASML HOLDING NV	95	102	2,906	343,265	半導体・半導体製造装置		
UNILEVER NV-CVA	358	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品		
VOPAK	14	15	75	8,875	エネルギー		
NN GROUP NV	75	90	235	27,781	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
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ALTICE EUROPE NV	—	—	154	58	6,957	メディア・娯楽
ABN AMRO BANK NV-CVA	91	—	87	55	6,603	銀行
ADYEN NV	2	—	2	262	30,942	ソフトウェア・サービス
JUST EAT TAKEAWAY	—	—	28	277	32,797	小売
PROSUS NV	—	—	115	940	111,035	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	4,470	4,837	12,821	1,514,232	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	27	—	< 1.6% >	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	64	—	48	63	7,480	資本財
ENDESA SA	72	—	72	146	17,267	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	55	—	62	129	15,313	資本財
IBERDROLA SA	1,451	—	1,459	1,300	153,590	公益事業
TELEFONICA SA	1,081	—	1,140	444	52,516	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	3,784	—	4,098	747	88,257	銀行
BANKINTER SA	176	—	150	52	6,152	銀行
REPSOL SA	323	—	336	287	33,936	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,542	—	1,670	434	51,260	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	76	—	62	96	11,404	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	250	—	262	605	71,456	小売
MAPPRE SA	297	—	335	49	5,847	保険
FERROVIAL SA	108	—	113	258	30,483	資本財
FERROVIAL SA-RTS	108	—	—	—	—	資本財
ENAGAS SA	60	—	51	104	12,331	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	94	—	101	159	18,848	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	1,253	—	1,272	34	4,105	銀行
CAIXABANK SA	792	—	784	121	14,353	銀行
GRIFOLS SA	72	—	70	204	24,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA	101	—	104	450	53,221	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA	331	—	331	26	3,163	銀行
AENA SME SA	16	—	16	187	22,129	運輸
CELLNEX TELECOM SA	—	—	60	300	35,493	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	12,117	12,607	6,204	732,733	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	22	—	< 0.8% >	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV	—	—	10	205	24,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGEAS	39	—	45	137	16,271	保険
UCB SA	29	—	29	246	29,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	19	—	19	130	15,437	各種金融
UMICORE	52	—	44	153	18,134	素材
COLRUYT SA	16	—	12	67	8,012	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV	57	—	61	260	30,779	銀行
SOLVAY SA	17	—	23	160	18,897	素材
PROXIMUS	28	—	37	66	7,839	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	14	—	10	33	3,991	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	176	—	180	683	80,662	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	452	474	2,146	253,508	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	11	—	< 0.3% >	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	66	—	73	134	15,914	銀行
VERBUND AG	17	—	17	64	7,635	公益事業
OMV AG	35	—	35	105	12,466	エネルギー
VOESTALPINE AG	18	—	27	46	5,541	素材

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ANDRITZ AG	19	13	40	4,771	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	40	29	44	5,306	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	197 6	196 6	437 —	51,636 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	10	—	—	—	メディア・娯楽	
AROUNDTOWN SA	192	270	128	15,130	不動産	
TENARIS SA	110	110	62	7,400	エネルギー	
SES	94	81	48	5,762	メディア・娯楽	
EUROFINS SCIENTIFIC	2	2	142	16,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	153	154	132	15,671	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	564 6	619 5	514 —	60,806 <0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	1,278	1,403	476	56,270	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	132	132	140	16,599	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	29	29	52	6,200	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	120	129	329	38,876	素材	
FORTUM OYJ	97	97	152	17,951	公益事業	
KONE OYJ-B	78	81	467	55,222	資本財	
METSO OYJ	29	21	57	6,841	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	105	119	356	42,052	保険	
WARTSILA OYJ ABP	104	104	72	8,548	資本財	
ELISA OYJ	31	32	170	20,188	電気通信サービス	
NESTE OYJ	89	95	316	37,434	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	27	21	94	11,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,124 12	2,268 12	2,686 —	317,317 <0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	37	37	384	45,451	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	37	33	167	19,724	資本財	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	20	19	233	27,595	消費者サービス	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW	—	0.4	4	554	消費者サービス	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	233	233	36	4,304	銀行	
AIB GROUP PLC	200	200	20	2,385	銀行	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	47	57	165	19,598	素材	
CRH PLC	189	188	516	61,001	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	766 7	771 8	1,529 —	180,615 <0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	634	574	233	27,628	公益事業	
JERONIMO MARTINS	54	54	79	9,391	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	109	133	139	16,476	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	799 3	762 3	452 —	53,495 <0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	45,514 239	46,849 237	79,166 —	9,349,559 <9.9%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BARCLAYS PLC	3,989	4,413	462	61,202	銀行	
BP PLC	4,671	4,871	1,530	202,682	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	16,655	17,613	521	69,008	銀行	
ASTRAZENECA PLC	295	315	2,734	362,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
SMITHS GROUP PLC	87	101	127	16,844	資本財
NEXT PLC	31	28	126	16,800	小売
DIAGEO PLC	565	563	1,601	212,098	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC	759	745	370	49,113	資本財
UNILEVER PLC	258	267	1,101	145,888	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	2,252	2,366	561	74,420	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	459	462	850	112,671	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	375	377	32	4,284	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	156	170	1,201	159,178	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	—	95	210	27,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC	603	618	693	91,847	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,425	1,570	301	39,991	保険
SAGE GROUP PLC/THE	261	262	174	23,128	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	4,669	4,866	2,002	265,222	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	533	551	1,679	222,424	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	146	165	148	19,673	公益事業
SCHRODERS PLC	28	28	80	10,651	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,095	1,197	127	16,917	銀行
BHP GROUP PLC	493	502	774	102,616	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	218	229	355	47,016	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	286	280	163	21,665	メディア・娯楽
CENTRICA PLC	1,333	1,333	49	6,571	公益事業
BT GROUP PLC	1,966	1,966	218	28,976	電気通信サービス
SSE PLC	233	242	296	39,322	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	656	636	261	34,601	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	387	409	109	14,510	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	29,619	—	—	—	資本財
COMPASS GROUP PLC	375	380	424	56,160	消費者サービス
KINGFISHER PLC	522	420	70	9,288	小売
PEARSON PLC	195	204	89	11,881	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	49	51	123	16,379	公益事業
RIO TINTO PLC	269	270	1,155	152,988	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,156	1,197	1,989	263,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	234	235	191	25,330	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	6,210	6,387	811	107,485	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	462	559	104	13,902	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	433	433	79	10,538	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	927	938	224	29,758	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	46	46	93	12,341	素材
RENTOKIL INITIAL PLC	—	436	212	28,182	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	244	244	90	12,032	保険
WHITBREAD PLC	40	32	94	12,550	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	780	828	757	100,307	公益事業
BUNZL PLC	74	84	151	20,107	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	240	266	428	56,728	素材
INTERTEK GROUP PLC	36	38	185	24,539	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	90	88	125	16,590	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	38	51	189	25,126	消費者サービス
CARNIVAL PLC	41	—	—	—	消費者サービス
PERSIMMON PLC	70	73	160	21,249	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	201	321	88	11,714	資本財
ITV PLC	728	758	58	7,683	メディア・娯楽

銘柄	株数	当期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	74	78	649	85,985	各種金融	
G4S PLC	405	—	—	—	商業・専門サービス	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	30	124	16,422	耐久消費財・アパレル	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	232	232	116	15,480	耐久消費財・アパレル	
SMITH & NEPHEW PLC	199	208	336	44,519	ヘルスケア機器・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	667	780	113	15,022	耐久消費財・アパレル	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,052	984	1,288	170,679	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	868	914	1,142	151,326	エネルギー	
INVESTEC PLC	182	—	—	—	各種金融	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	610	517	120	15,993	各種金融	
EXPERIAN PLC	213	225	569	75,468	商業・専門サービス	
MONDI PLC	79	103	140	18,636	素材	
WEIR GROUP PLC/THE	59	59	58	7,721	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	88	77	129	17,102	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	101	108	90	12,023	素材	
ADMIRAL GROUP PLC	42	42	97	12,883	保険	
FRESNILLO PLC	59	—	—	—	素材	
BABCOCK INTL GROUP PLC	69	—	—	—	商業・専門サービス	
ST JAMES' S PLACE PLC	110	128	107	14,175	各種金融	
GLENCORE PLC	2,625	2,603	400	53,100	素材	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	17	163	21,598	資本財	
EVRAZ PLC	—	117	30	4,092	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	67	67	112	14,852	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	32	29	146	19,384	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,101	1,130	107	14,296	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	49	49	91	12,118	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	44	—	—	—	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	273	335	89	11,837	保険	
ROYAL MAIL PLC	200	—	—	—	運輸	
AVEVA GROUP PLC	—	15	59	7,836	ソフトウェア・サービス	
ASHTED GROUP PLC	108	112	253	33,619	資本財	
MERLIN ENTERTAINMENT	154	—	—	—	消費者サービス	
TUI AG-DI	104	—	—	—	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	81	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
NMC HEALTH PLC	25	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
OCADO GROUP PLC	—	105	206	27,359	小売	
AUTO TRADER GROUP PLC	186	221	113	14,969	メディア・娯楽	
DCC PLC	24	25	153	20,318	資本財	
GVC HOLDINGS PLC	136	136	107	14,247	消費者サービス	
CONVATEC GROUP PLC	322	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
JOHN WOOD GROUP PLC	176	—	—	—	エネルギー	
INFORMA PLC	278	310	134	17,876	メディア・娯楽	
FERGUSON PLC	53	54	334	44,282	資本財	
M&G PLC	—	539	65	8,680	各種金融	
JD SPORTS FASHION PLC	—	102	57	7,591	小売	
小計	株数・金額	99,182	72,072	34,487	4,567,119	
	銘柄数<比率>	93	87	—	<4.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	712	711	7,501	834,631	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	120	131	720	80,117	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	588	624	513	57,160	各種金融	
LAFARGEHOCLIM LTD-REG	116	126	472	52,614	素材	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	163	168	5,866	652,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	2	2	759	84,531	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	13	13	272	30,293	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35	34	1,007	112,087	保険	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2	2	167	18,603	ヘルスケア機器・サービス	
LONZA GROUP AG-REG	17	17	840	93,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	9	14	51	5,686	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8	10	223	24,916	資本財	
GEBERIT AG-REG	8	9	445	49,574	資本財	
SWISS RE AG	73	73	458	51,065	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	6	117	13,047	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	5	9	61	6,876	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	504	514	4,260	474,031	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	39	39	169	18,873	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	6	6	292	32,504	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	422	454	834	92,891	資本財	
CLARIANT AG-REG	50	50	85	9,529	素材	
SGS SA-REG	1	1	349	38,860	商業・専門サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6	3	77	8,667	資本財	
TEMENOS AG - REG	12	15	212	23,630	ソフトウェア・サービス	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12	12	176	19,615	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	11	10	140	15,621	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	7	256	28,588	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.03	250	27,870	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	54	55	216	24,079	各種金融	
SIKA AG-REG	29	30	520	57,905	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	14	18	164	18,325	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.26	0.26	207	23,055	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3	4	327	36,398	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.59	0.72	134	14,988	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	1	124	13,883	素材	
UBS GROUP AG-REG	892	911	884	98,418	各種金融	
DUFREY AG-REG	8	—	—	—	小売	
VIFOR PHARMA AG	9	10	157	17,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALCON INC	98	105	618	68,760	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株数・金額	4,075	4,213	29,943	3,331,477	
	銘柄数<比率>	39	38	—	<3.5%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	62	51	742	8,276	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	709	756	6,349	70,796	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	83	95	3,073	34,266	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	371	387	2,925	32,620	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	105	105	5,081	56,655	各種金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	350	365	3,159	35,228	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	159	158	5,667	63,188	資本財	
SKF AB-B SHARES	90	90	1,434	15,992	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	239	236	4,308	48,041	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	195	193	2,533	28,244	小売	
SANDVIK AB	261	292	4,355	48,562	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	204	217	2,334	26,025	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	58	73	857	9,555	商業・専門サービス	
SKANSKA AB-B SHS	80	80	1,413	15,760	資本財	

銘柄	株数	当期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
SWEDISH MATCH AB	42	41	2,613	29,141	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	122	103	1,272	14,191	電気通信サービス	
TELIA CO AB	618	593	1,870	20,854	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	367	349	4,450	49,624	資本財	
ALFA LAVAL AB	60	73	1,345	15,005	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	44	44	1,031	11,506	エネルギー	
BOLIDEN AB	63	63	1,309	14,601	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	107	107	675	7,533	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	11	24	484	5,402	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	63	63	3,012	33,592	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINNEVIK AB - B	60	49	1,080	12,043	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	41	41	821	9,165	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	20	20	852	9,501	食品・生活必需品小売り	
LUNDBERGS AB-B SHS	20	20	862	9,620	各種金融	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	143	142	4,375	48,791	家庭用品・パーソナル用品	
EPIROC AB-B	95	95	970	10,822	資本財	
EPIROC AB-A	137	159	1,633	18,216	資本財	
NORDEA BANK ABP	730	753	4,396	49,025	銀行	
小計	株数・金額	5,722	5,850	77,296	861,856	
	銘柄数<比率>	32	32	—	<0.9%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	224	210	2,522	27,315	銀行	
NORSK HYDRO ASA	311	311	754	8,168	素材	
ORKLA ASA	165	185	1,599	17,327	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	264	244	3,575	38,717	エネルギー	
TELENOR ASA	172	173	2,520	27,294	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	42	42	1,380	14,950	素材	
MOWI ASA	104	92	1,737	18,822	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	37	50	890	9,640	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	25	25	552	5,980	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	26	26	428	4,643	エネルギー	
小計	株数・金額	1,374	1,361	15,961	172,861	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	423	426	18,934	299,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	48	48	1,702	26,960	素材	
DANSKE BANK A/S	167	149	1,117	17,695	銀行	
DEMANT A/S	26	26	436	6,918	ヘルスケア機器・サービス	
H LUNDBECK A/S	18	18	483	7,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	45	49	3,074	48,698	資本財	
CARLSBERG AS-B	26	29	2,439	38,641	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	28	27	3,017	47,800	ヘルスケア機器・サービス	
DSV PANALPINA A/S	43	50	3,655	57,898	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1	1	1,011	16,026	運輸	
TRYG A/S	30	30	560	8,885	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.92	0.92	598	9,486	運輸	
PANDORA A/S	26	21	628	9,956	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	32	40	431	6,833	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	23	26	1,702	26,963	素材	
GENMAB A/S	13	15	3,073	48,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円		
ORSTED A/S	41	44	3,214	50,914		公益事業
小計	株数・金額	998	1,007	46,081	729,931	
	銘柄数<比率>	17	17	—	<0.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD	686	711	2,492	176,364		素材
CSL LTD	105	109	3,311	234,316		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	460	616	90	6,437		素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	223	230	520	36,844		エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	668	683	1,055	74,651		銀行
RTIO TINTO LTD	84	86	819	57,952		素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	297	287	223	15,791		保険
LENLELEASE GROUP	146	144	168	11,955		不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	412	427	2,551	180,516		銀行
WESTPAC BANKING CORP	800	898	1,368	96,841		銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	639	763	1,182	83,644		銀行
BRAMBLES LTD	389	378	418	29,575		商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	—	168	58	4,161		運輸
BORAL LTD	277	277	71	5,069		素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	301	306	1,073	75,958		食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	1,017	912	283	20,077		電気通信サービス
AMP LTD	715	715	105	7,493		各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	458	461	150	10,618		消費者サービス
AMCOR LIMITED	287	—	—	—		素材
COMPUTERSHARE LTD	94	115	140	9,933		ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	127	122	329	23,316		消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	74	83	882	62,463		各種金融
CIMIC GROUP LTD	27	19	46	3,270		資本財
ASX LTD	43	47	398	28,208		各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	119	119	103	7,292		食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	14	12	229	16,214		ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	91	111	265	18,785		素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	159	159	46	3,312		小売
NEWCREST MINING LTD	187	188	604	42,771		素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	508	568	309	21,927		保険
ORIGIN ENERGY LTD	430	383	217	15,362		エネルギー
ORICA LTD	73	91	153	10,880		素材
SONIC HEALTHCARE LTD	106	106	289	20,511		ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	377	383	195	13,825		エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	321	401	352	24,939		保険
TRANSURBAN GROUP	612	673	930	65,853		運輸
WESFARMERS LTD	260	281	1,091	77,194		小売
BLUESCOPE STEEL LTD	130	105	108	7,641		素材
CHALLENGER LTD	134	134	59	4,228		各種金融
SYDNEY AIRPORT	261	261	146	10,357		運輸
AMPOL LTD	62	50	131	9,337		エネルギー
OIL SEARCH LTD	332	332	107	7,573		エネルギー
WORLEY LTD	77	—	—	—		エネルギー
AGL ENERGY LTD	164	165	275	19,517		公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	367	340	472	33,398		素材
AUSNET SERVICES	572	543	104	7,361		公益事業
CROWN RESORTS LTD	83	83	79	5,590		消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	376	376	73	5,194		素材

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	127	127	73	5,203	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	527	432	200	14,170	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	167	167	167	11,835	食品・飲料・タバコ	
APA GROUP	—	288	332	23,554	公益事業	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	32	38	258	18,307	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	14	15	1,101	消費者サービス	
SEEK LTD	66	84	151	10,747	メディア・娯楽	
BANK OF QUEENSLAND LTD	110	—	—	—	銀行	
REA GROUP LTD	9	13	132	9,407	メディア・娯楽	
TPG TELECOM LTD	104	104	75	5,357	電気通信サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	687	687	197	13,955	保険	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	17	—	—	—	消費者サービス	
SOUTH32 LTD	1,200	1,061	211	14,945	素材	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	31	174	12,359	各種金融	
WASHINGTON H. SOUL PATTONSON	27	27	49	3,516	エネルギー	
COLES GROUP LTD	280	311	475	33,645	食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	—	32	67	4,741	ソフトウェア・サービス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,542 61	17,868 61	26,676 —	1,887,386 <2.0%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	482	483	223	14,745	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	170	216	124	8,216	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	138	138	415	27,414	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	177	177	60	3,980	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	70	104	131	8,693	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	356	265	127	8,399	公益事業	
MERCURY NZ LTD	—	145	72	4,760	公益事業	
A2 MILK CO LTD	182	182	353	23,309	食品・飲料・タバコ	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,578 7	1,714 8	1,509 —	99,519 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	320	—	—	—	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	100	120	591	8,232	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	611	641	3,530	49,180	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	375	375	3,720	51,819	不動産	
MTR CORP	380	365	1,536	21,405	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	2,111	2,433	3,377	47,053	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,340	1,520	1,377	19,183	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	345	315	1,508	21,018	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	270	286	7,584	105,655	各種金融	
HANG LUNG GROUP LTD	240	—	—	—	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	450	450	757	10,556	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	375	400	3,222	44,882	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	281	353	1,072	14,940	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	329	329	523	7,286	銀行	
HANG SENG BANK LTD	181	180	2,415	33,649	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	170	—	—	—	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	360	—	—	—	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	71	71	546	7,615	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	842	682	705	9,823	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	120	157	2,189	耐久消費財・アパレル	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	150	672	9,360	公益事業	

銘柄	株数	当期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	835	885	2,168	30,203	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	335	330	2,244	31,258	資本財
PCCW LTD	1,240	800	356	4,970	電気通信サービス
KERRY PROPERTIES LTD	185	185	391	5,450	不動産
MINTH GROUP LTD	180	—	—	—	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD	310	310	237	3,307	資本財
SANDS CHINA LTD	528	692	2,148	29,930	消費者サービス
WHEELOK & CO LTD	210	210	1,186	16,527	不動産
WYNN MACAU LTD	308	316	450	6,277	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	580	580	489	6,819	消費者サービス
AIA GROUP LTD	2,796	2,908	20,472	285,179	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	250	250	530	7,382	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	560	530	2,811	39,166	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	264	—	—	—	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	960	780	934	13,016	電気通信サービス
WH GROUP LTD	2,120	2,195	1,492	20,791	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	616	616	2,936	40,905	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	650	514	7,162	公益事業
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	260	300	985	13,728	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	180	634	8,838	食品・飲料・タバコ
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	291	644	8,978	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,051 39	21,801 36	74,928 —	1,043,750 <1.1%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	752	746	671	51,200	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	306	306	45	3,435	メディア・娯楽
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	293	293	45	3,463	資本財
CAPITALAND LTD	612	612	179	13,721	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	61	102	79	6,036	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	27	54	4,194	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	411	409	802	61,164	銀行
KEPPEL CORP LTD	348	348	212	16,215	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	302	285	565	43,120	銀行
VENTURE CORP LTD	70	70	109	8,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING	294	385	128	9,776	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,916	1,934	522	39,839	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	141	141	52	3,989	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	212	187	186	14,189	各種金融
UOL GROUP LTD	138	88	58	4,435	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	562	562	87	6,685	運輸
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,857	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	444	444	171	13,069	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD	1,397	1,397	107	8,203	消費者サービス
SATS LTD	188	210	59	4,548	運輸
YANGZIJANG SHIPBUILDING	635	635	60	4,576	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,968 21	9,182 20	4,199 —	320,247 <0.3%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
ICL GROUP LTD	189	141	167	5,148	素材
BANK HAPOALIM BM	251	251	550	16,910	銀行
NICE LTD	15	13	851	26,174	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	316	354	655	20,131	銀行

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエルシェケル	千円		
ELBIT SYSTEMS LTD	5	5	275	8,463		資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	269	290	8,912		銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	593	—	—	—		電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	38	38	262	8,061		銀行
AZRIELI GROUP LTD	11	11	210	6,483		不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,421 8	1,086 8	3,263 —	100,285 <0.1%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	290,745 1,252	263,885 1,236	— —	90,255,775 <95.4%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	10	12	289	31,207	0.0
MACERICH CO/THE	2	—	—	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	2	434	46,961	0.0
PROLOGIS INC	14	17	1,494	161,405	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	200	21,701	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	3	121	13,127	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	4	6	822	88,855	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	3	236	25,495	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	362	39,109	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	3	276	29,848	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	142	15,367	0.0
WELLTOWER INC	8	10	468	50,549	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	3	3	291	31,477	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	11	206	22,306	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	3	341	36,860	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	5	154	16,705	0.0
REALTY INCOME CORP	7	7	408	44,145	0.0
REGENCY CENTERS CORP	3	3	162	17,553	0.0
SL GREEN REALTY CORP	1	1	71	7,773	0.0
SUN COMMUNITIES INC	—	2	285	30,799	0.0
UDR INC	6	6	237	25,612	0.0
VENTAS INC	8	8	284	30,752	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	33	—	—	—	—
WEYERHAEUSER CO	16	17	328	35,518	0.0
AMERICAN TOWER CORP	10	10	2,440	263,543	0.3
AGNC INVESTMENT CORP	12	—	—	—	—
WP CAREY INC	3	4	249	26,963	0.0
VEREIT INC	20	35	175	19,003	0.0
DUKE REALTY CORP	8	8	267	28,924	0.0
IRON MOUNTAIN INC	6	6	157	16,957	0.0
EQUINIX INC	1	2	1,330	143,701	0.2
CROWN CASTLE INTL CORP	9	9	1,521	164,256	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	8	9	532	57,508	0.1
INVITATION HOMES INC	7	12	327	35,356	0.0
VICI PROPERTIES INC	—	10	185	20,021	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	2	—	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	2	770	83,193	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	16	15	180	19,523	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	3	3	691	74,712	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	7	420	45,429	0.0
VORNADO REALTY TRUST	4	3	141	15,289	0.0
KIMCO REALTY CORP	9	9	101	10,977	0.0

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
AVALONBAY COMMUNITIES INC		3	3	508	54,923	0.1
小 計		279	295	17,627	1,903,421	
		銘柄数<比率>	38	39	—	<0.0%>
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1	1	35	2,746	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		—	1	80	6,276	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	3	33	2,589	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4	4	61	4,807	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	2	30	2,398	0.0
小 計		9	13	242	18,817	
		銘柄数<比率>	3	5	—	<0.0%>
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	118	13,967	0.0
KLEPIERRE		5	4	59	7,015	0.0
COVIVIO		1	1	58	6,917	0.0
ICADE		0.932	0.634	39	4,720	0.0
小 計		8	7	276	32,620	
		銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3	3	157	18,648	0.0
小 計		3	3	157	18,648	
		銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
ユ ー ロ 計		11	10	434	51,269	
		銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		22	17	61	8,165	0.0
HAMMERSON PLC		17	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		17	15	88	11,655	0.0
SEGRO PLC		25	25	206	27,365	0.0
小 計		83	58	356	47,186	
		銘柄数<比率>	4	3	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		83	63	97	6,927	0.0
SCENTRE GROUP		121	117	263	18,671	0.0
GPT GROUP		39	45	186	13,217	0.0
MIRVAC GROUP		94	91	200	14,196	0.0
STOCKLAND		47	57	171	12,115	0.0
DEXUS		21	27	247	17,475	0.0
GOODMAN GROUP		39	40	594	42,056	0.0
小 計		447	444	1,762	124,661	
		銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		50	54	3,731	51,978	0.1
小 計		50	54	3,731	51,978	
		銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポールドル	千円	%	
SUNTEC REIT	53	100	143	10,915	0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	58	58	93	7,121	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	45	87	6,691	0.0	
CAPITALAND MALL TRUST	64	64	121	9,261	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51	63	194	14,813	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	227	333	639	48,803	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,110	1,209	—	2,246,139	
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	65	—	<2.4%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
		百万円	百万円
外	株式先物取引	1,528	—
	SP EMINI	55	—
	SP/TSE60	65	—
	SWISS IX	290	—
国	EURO ST	98	—
	SPI 200	119	—
	FTSE100		

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
投資証券	90,255,775	95.4
コール・ローン等、その他	2,246,139	2.4
投資信託財産総額	2,127,205	2.2
	94,629,119	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(94,539,008千円)の投資信託財産総額(94,629,119千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=107.98円	1 カナダドル=77.58円	1 ユーロ=118.10円	1 イギリスポンド=132.43円
1 スイスフラン=111.26円	1 スウェーデンクローネ=11.15円	1 ノルウェークローネ=10.83円	1 デンマーククローネ=15.84円
1 オーストラリアドル=70.75円	1 ニュージーランドドル=65.95円	1 香港ドル=13.93円	1 シンガポールドル=76.26円
1 イスラエルシェケル=30.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	94,749,856,192
コール・ローン等	1,284,046,649
株式(評価額)	90,255,775,015
投資証券(評価額)	2,246,139,687
未収入金	301,712,948
未収配当金	129,750,837
差入委託証拠金	532,431,056
(B) 負債	144,286,080
未払金	121,583,443
未払解約金	22,702,472
未払利息	165
(C) 純資産総額(A-B)	94,605,570,112
元本	40,411,414,293
次期繰越損益金	54,194,155,819
(D) 受益権総口数	40,411,414,293口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,411円

<注記事項>

- ①期首元本額 40,500,882,275円
 期中追加設定元本額 13,150,569,171円
 期中一部解約元本額 13,240,037,153円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,3411円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	14,336,178,889円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	12,746,538,230円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	5,478,324,998円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,838,660,799円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,737,539,100円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,309,453,142円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,105,799,032円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	336,571,364円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	224,512,997円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	109,191,063円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国株式)	62,521,115円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	51,538,048円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	42,315,079円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	26,160,337円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	6,076,633円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)VA(適格機関投資家限定)	33,467円
合計	40,411,414,293円

○損益の状況 (2019年5月21日~2020年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,996,315,000
受取配当金	1,978,930,739
受取利息	14,402,508
その他収益金	6,139,107
支払利息	△ 3,157,354
(B) 有価証券売買損益	△ 2,738,364,349
売買益	11,630,380,501
売買損	△14,368,744,850
(C) 先物取引等取引損益	△ 104,594,138
取引益	783,933,647
取引損	△ 888,527,785
(D) 保管費用等	△ 38,247,342
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 884,890,829
(F) 前期繰越損益金	56,963,568,624
(G) 追加信託差損益金	17,005,324,635
(H) 解約差損益金	△18,889,846,611
(I) 計(E+F+G+H)	54,194,155,819
次期繰越損益金(I)	54,194,155,819

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

(注) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

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

【お 知 ら せ】

株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2019年7月1日)