

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   | 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、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                                                                                                                                                                                                                          | 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。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                                                                                                                                                                                                                          | 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                                                                                                                                                                                                                          | 株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。                                      |
| 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4期（決算日：2022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4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）

お客さまのお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<br>(分配落) | 価 額        |            |              | MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み、<br>円換算ベース) |      | 株 式<br>組 入 比 率 | 株 式<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 劵 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|----------------|--------------|------------|------------|--------------|--------------------------------------|------|----------------|----------------|------------------------|--------------|
|                |              | 税 込<br>分 配 | み 金<br>騰 落 | 期 中<br>騰 落 率 | 期 中<br>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                    |              |
| 3期(2021年5月20日) | 13,663       | 0          | 46.2       | 1,088,325.89 | 46.1                                 | 95.5 | 2.4            | 2.1            | 2,005                  |              |
| 4期(2022年5月20日) | 14,877       | 0          | 8.9        | 1,183,704.08 | 8.8                                  | 93.9 | 3.7            | 2.3            | 7,037                  |              |

(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) 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) 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     | 騰 落 率  | MSCIコクサイ・インデックス   |        | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|---------------------|-------------|--------|-------------------|--------|-----------|-----------|---------------------|
|                     |             |        | (配当込み、<br>円換算ベース) | 騰 落 率  |           |           |                     |
| (期 首)<br>2021年5月20日 | 円<br>13,663 | %<br>— | 1,088,325.89      | %<br>— | %<br>95.5 | %<br>2.4  | %<br>2.1            |
| 5月末                 | 14,072      | 3.0    | 1,120,295.08      | 2.9    | 94.5      | 3.4       | 2.1                 |
| 6月末                 | 14,421      | 5.5    | 1,148,321.00      | 5.5    | 93.6      | 3.1       | 2.1                 |
| 7月末                 | 14,624      | 7.0    | 1,164,636.70      | 7.0    | 94.1      | 2.8       | 2.2                 |
| 8月末                 | 14,983      | 9.7    | 1,193,049.12      | 9.6    | 95.0      | 2.3       | 2.2                 |
| 9月末                 | 14,633      | 7.1    | 1,165,043.55      | 7.0    | 97.8      | 3.3       | 2.2                 |
| 10月末                | 15,700      | 14.9   | 1,250,124.47      | 14.9   | 95.6      | 1.7       | 2.2                 |
| 11月末                | 15,637      | 14.4   | 1,244,334.35      | 14.3   | 94.6      | 2.9       | 2.2                 |
| 12月末                | 16,275      | 19.1   | 1,295,472.56      | 19.0   | 93.5      | 4.3       | 2.2                 |
| 2022年1月末            | 15,135      | 10.8   | 1,204,715.68      | 10.7   | 96.0      | 1.7       | 2.3                 |
| 2月末                 | 15,033      | 10.0   | 1,197,243.59      | 10.0   | 96.2      | 1.5       | 2.2                 |
| 3月末                 | 16,630      | 21.7   | 1,323,494.86      | 21.6   | 95.4      | 1.7       | 2.3                 |
| 4月末                 | 15,917      | 16.5   | 1,265,687.53      | 16.3   | 94.1      | 3.0       | 2.5                 |
| (期 末)<br>2022年5月20日 | 14,877      | 8.9    | 1,183,704.08      | 8.8    | 93.9      | 3.7       | 2.3                 |

(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) 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4期：2021年5月21日～2022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



※2021年10月20日にマザーファンドの入れ替えが終了したため、区切り線を入れております。

|       |         |
|-------|---------|
| 第4期首  | 13,663円 |
| 第4期末  | 14,877円 |
| 既払分配金 | 0円      |
| 騰落率   | 8.9%    |

※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8.9%の上昇となりました。  
なお、期中にマザーファンドの入れ替えを行いました。

**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（8.8%）を0.1%上回りました。

**> 基準価額の主な変動要因****上昇要因**

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４期：2021年5月21日～2022年5月20日

## 投資環境について

### ▶ 外国株式市況

**外国株式市況は下落しました。**

堅調な経済指標や企業決算等を受けて外国株式市況は上昇する局面もありましたが、世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて外国株式市況は下落しました。

### ▶ 為替市況

**米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。**

為替市況は、期首に比べて17.0%の円安・米ドル高、1.6%の円安・ユーロ高となりました。

## 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。なお、2021年10月20日に「三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド受益証券」から「外国株式インデックスマザーファンド受益証券」へ投資対象マザーファンドの入れ替えを行いました。

### ▶ 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

### ▶ 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（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・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0.1%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0.3%程度でした。

### ▶ 三菱UFJ 外国株式マザーファンド（期首～組入終了時）

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。

### ▶ 外国株式インデックスマザーファンド（組入開始時～期末）

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

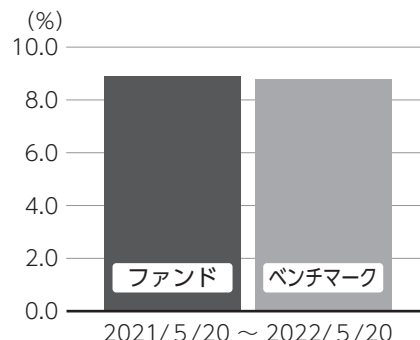
**主なプラス要因：**その他の要因\*によるものです。

※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：**為替評価差異要因\*によるものです。

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる為替レートが異なるため生じる要因です。

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4期<br>2021年5月21日～2022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      | 4,876                        |

（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。

### ▶ 外国株式インデックスマザーファンド

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。

2021年5月21日～2022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   | 23     | 0.154   | (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 ）  | (10)   | (0.066) | 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 ）  | (10)   | (0.066) | 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 ）  | (3)    | (0.022) | 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   | 0      | 0.003   | (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>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 ）      | (0)    | (0.001) |                                                                  |
| （投資信託証券）     | (0)    | (0.000) |                                                                  |
| （先物・オプション）   | (0)    | (0.001) |                                                                  |
| (c)有価証券取引税   | 1      | 0.009   | (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>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金       |
| （ 株 式 ）      | (1)    | (0.009) |                                                                  |
| （投資信託証券）     | (0)    | (0.000) |                                                                  |
| (d)そ の 他 費 用 | 6      | 0.039   | (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 ）  | (4)    | (0.026) | 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 ）  | (1)    | (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 ）    | (1)    | (0.009) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用                                               |
| 合 計          | 30     | 0.205   |                                                                  |

期中の平均基準価額は、15,205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。

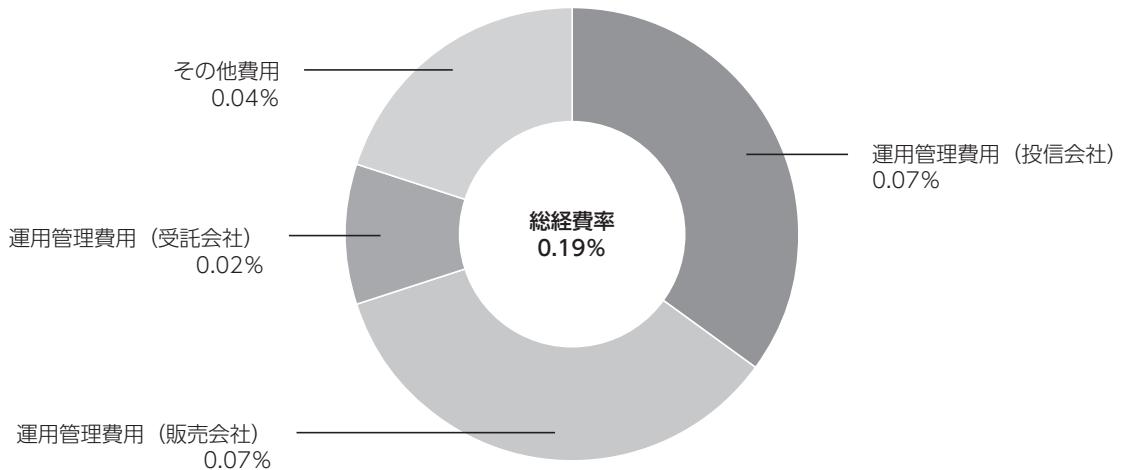
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.19%**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

(2021年5月21日～2022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       |
|                   | 千口        | 千円        | 千口        | 千円        |
| 三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド | 437,994   | 1,594,612 | 1,022,967 | 3,960,223 |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 1,649,308 | 7,424,139 | 17,176    | 74,823    |

## ○株式売買比率

(2021年5月21日～2022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<br>マザーファンド | 外国株式インデックス<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 134,012,843千円         | 540,064,130千円         |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 117,343,158千円         | 1,387,450,920千円       |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.14                  | 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

(2021年5月21日～2022年5月20日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国株式）&gt;

該当事項はございません。

## &lt;三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|        |               |                    |               |                |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>11,092 | 百万円<br>10,812      | %<br>97.5     | 百万円<br>142,015 | 百万円<br>138,970     | %<br>97.9     |

平均保有割合 2.5%

※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。

<外国株式インデックスマザーファンド>

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        | 百万円       | 百万円                | %             | 百万円       | 百万円                | %             |
| 為替直物取引 | 712,755   | 686,465            | 96.3          | 311,236   | 294,879            | 94.7          |

平均保有割合 0.4%

※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。

○組入資産の明細

(2022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<br>584,972 | 千口<br>—   | 千円<br>—   |
| 外国株式インデックスマザーファンド | —             | 1,632,132 | 7,036,610 |

○投資信託財産の構成

(2022年5月20日現在)

| 項 目               | 当 期 末           |           |
|-------------------|-----------------|-----------|
|                   | 評 価 額           | 比 率       |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 千円<br>7,036,610 | %<br>99.8 |
| コール・ローン等、その他      | 17,472          | 0.2       |
| 投資信託財産総額          | 7,054,082       | 100.0     |

(注) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(1,455,440,341千円)の投資信託財産総額(1,460,794,727千円)に対する比率は99.6%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=127.85円     | 1 カナダドル=99.67円      | 1 ユーロ=135.19円      | 1 イギリスポンド=159.30円  |
| 1 スイスフラン=131.37円     | 1 スウェーデンクローネ=12.87円 | 1 ノルウェークローネ=13.19円 | 1 デンマーククローネ=18.16円 |
| 1 オーストラリアドル=89.73円   | 1 ニュージーランドドル=81.52円 | 1 香港ドル=16.29円      | 1 シンガポールドル=92.60円  |
| 1 イスラエルシェケル=37.9755円 |                     |                    |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年5月20日現在）

| 項 目                    | 当 期 末          |
|------------------------|----------------|
|                        | 円              |
| (A) 資産                 | 7,054,082,302  |
| コール・ローン等               | 17,471,309     |
| 外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 7,036,610,993  |
| (B) 負債                 | 16,774,727     |
| 未払解約金                  | 12,058,574     |
| 未払信託報酬                 | 4,614,040      |
| 未払利息                   | 7              |
| その他未払費用                | 102,106        |
| (C) 純資産総額(A－B)         | 7,037,307,575  |
| 元本                     | 4,730,446,117  |
| 次期繰越損益金                | 2,306,861,458  |
| (D) 受益権総口数             | 4,730,446,117口 |
| 1万円当たり基準価額(C／D)        | 14,877円        |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 1,467,761,340円  
 期中追加設定元本額 3,951,303,124円  
 期中一部解約元本額 688,618,347円  
 また、1口当たり純資産額は、期末14,877円です。

## ②分配金の計算過程

| 項 目                       | 2021年5月21日～<br>2022年5月20日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 75,521,213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                    | 1,961,388,023円            |
| 分配準備積立金額                  | 269,952,222円              |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 2,306,861,458円            |
| 1万円当たり収益分配対象額             | 4,876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（2021年5月21日～2022年5月20日）

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
|                  | 円                |
| (A) 配当等収益        | 118,887          |
| 受取利息             | 30               |
| その他収益金           | 120,139          |
| 支払利息             | △ 1,282          |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 5,800,738      |
| 売買益              | 332,456,775      |
| 売買損              | △ 338,257,513    |
| (C) 信託報酬等        | △ 7,309,426      |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | △ 12,991,277     |
| (E) 前期繰越損益金      | 269,952,222      |
| (F) 追加信託差損益金     | 2,049,900,513    |
| (配当等相当額)         | ( 927,341,147)   |
| (売買損益相当額)        | ( 1,122,559,366) |
| (G) 計(D＋E＋F)     | 2,306,861,458    |
| (H) 収益分配金        | 0                |
| 次期繰越損益金(G＋H)     | 2,306,861,458    |
| 追加信託差損益金         | 2,049,900,513    |
| (配当等相当額)         | ( 931,102,938)   |
| (売買損益相当額)        | ( 1,118,797,575) |
| 分配準備積立金          | 345,473,435      |
| 繰越損益金            | △ 88,512,490     |

- (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投資の対象とするマザーファンドの追加および付随する変更を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2021年8月20日)
- ②投資の対象とするマザーファンドの削除および付随する変更を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2021年12月28日)

## 外国株式インデックスマザーファンド

### 《第21期》決算日2022年5月12日

[計算期間：2021年5月13日～2022年5月12日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第21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21期の運用状況をご報告申し上げます。

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針     | MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をMSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主 要 運 用 対 象 | 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制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。                                                                                                                                                                                                                        |

### ○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>(配当込み、円換算ベース) |       | 株<br>組 入 比 率 | 株<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 書 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-----------------|---------|-------|-----------------------------------|-------|--------------|--------------|------------------------|--------------|
|                 | 円       | 騰 落 率 | 円                                 | 騰 落 率 |              |              |                        |              |
| 17期(2018年5月14日) | 26,785  | 10.2  | 742,711.39                        | 9.9   | 94.4         | 3.4          | 2.2                    | 337,226      |
| 18期(2019年5月13日) | 27,724  | 3.5   | 767,126.93                        | 3.3   | 93.8         | 3.8          | 2.5                    | 437,368      |
| 19期(2020年5月12日) | 26,834  | △ 3.2 | 740,810.97                        | △ 3.4 | 93.7         | 4.0          | 2.4                    | 449,841      |
| 20期(2021年5月12日) | 39,579  | 47.5  | 1,089,727.74                      | 47.1  | 93.4         | 4.5          | 2.1                    | 974,704      |
| 21期(2022年5月12日) | 43,788  | 10.6  | 1,203,027.98                      | 10.4  | 94.9         | 2.9          | 2.3                    | 1,466,498    |

(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<br>(配当込み、<br>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)<br>2021年5月12日 | 円       | %     |                                       | %     | %         | %         | %                   |
|                     | 39,579  | —     | 1,089,727.74                          | —     | 93.4      | 4.5       | 2.1                 |
| 5月末                 | 40,713  | 2.9   | 1,120,295.08                          | 2.8   | 94.5      | 3.2       | 2.1                 |
| 6月末                 | 41,729  | 5.4   | 1,148,321.00                          | 5.4   | 93.4      | 4.5       | 2.1                 |
| 7月末                 | 42,325  | 6.9   | 1,164,636.70                          | 6.9   | 95.3      | 2.5       | 2.2                 |
| 8月末                 | 43,370  | 9.6   | 1,193,049.12                          | 9.5   | 95.3      | 2.4       | 2.2                 |
| 9月末                 | 42,363  | 7.0   | 1,165,043.55                          | 6.9   | 94.6      | 3.3       | 2.2                 |
| 10月末                | 45,461  | 14.9  | 1,250,124.47                          | 14.7  | 95.6      | 1.7       | 2.2                 |
| 11月末                | 45,285  | 14.4  | 1,244,334.35                          | 14.2  | 94.6      | 2.9       | 2.2                 |
| 12月末                | 47,137  | 19.1  | 1,295,472.56                          | 18.9  | 93.5      | 4.3       | 2.2                 |
| 2022年1月末            | 43,842  | 10.8  | 1,204,715.68                          | 10.6  | 96.0      | 1.7       | 2.3                 |
| 2月末                 | 43,550  | 10.0  | 1,197,243.59                          | 9.9   | 96.2      | 1.5       | 2.2                 |
| 3月末                 | 48,183  | 21.7  | 1,323,494.86                          | 21.5  | 95.4      | 1.7       | 2.3                 |
| 4月末                 | 46,125  | 16.5  | 1,265,687.53                          | 16.1  | 94.1      | 3.0       | 2.5                 |
| (期 末)<br>2022年5月12日 | 43,788  | 10.6  | 1,203,027.98                          | 10.4  | 94.9      | 2.9       | 2.3                 |

(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

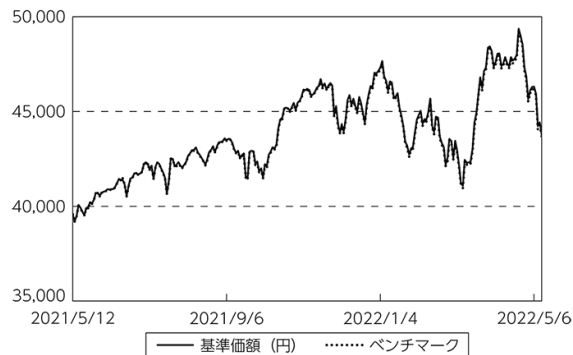
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ10.6%の上昇となりました。

## ◎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(10.4%)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  
(上昇要因)

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

外国株式市況は下落しました。

- ・ 堅調な経済指標や企業決算等を受けて外国株式市況は上昇する局面もありましたが、世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて外国株式市況は下落しました。

◎為替市況

米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

- ・ 為替市況は、期首に比べて19.3%の円安・米ドル高、3.4%の円安・ユーロ高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ M S C I 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（R E I T）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10.4%の上昇になったため、カ  
イ離は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)

- ・ 為替評価差異要因※によるものです。

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる為替レ  
ートが異なるため生じる要因です。

○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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                                                              |
|-----------------------|--------|------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                                                        |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>1 | %<br>0.003 | (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>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)    | (0.001)    |                                                                                        |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                                        |
| (先物・オプション)            | (1)    | (0.002)    |                                                                                        |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 5      | 0.011      | (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>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (株 式)                 | (5)    | (0.011)    |                                                                                        |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                                        |
| (c) そ の 他 費 用         | 11     | 0.026      | (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>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<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (9)    | (0.021)    |                                                                                        |
| (そ の 他)               | (2)    | (0.005)    |                                                                                        |
| 合 計                   | 17     | 0.040      |                                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、43,911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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

## 株式

|     |          | 買 付                       |                                     | 売 付                      |                                    |
|-----|----------|---------------------------|-------------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|     |          | 株 数                       | 金 額                                 | 株 数                      | 金 額                                |
| 外 国 | アメリカ     | 百株<br>256,260<br>( 8,040) | 千アメリカドル<br>3,119,161<br>( 26,808)   | 百株<br>38,644<br>( 7,986) | 千アメリカドル<br>479,698<br>( 42,102)    |
|     | カナダ      | 33,562<br>( 794)          | 千カナダドル<br>202,933<br>(△ 172)        | 9,439                    | 千カナダドル<br>29,441                   |
|     | ユーロ      |                           | 千ユーロ                                |                          | 千ユーロ                               |
|     | ドイツ      | 19,837<br>( 2,818)        | 98,702<br>(△ 359)                   | 6,255                    | 17,845                             |
|     | イタリア     | 41,537<br>( ー)            | 19,945<br>(△ 8)                     | 19,678                   | 2,758                              |
|     | フランス     | 19,486<br>( 3,037)        | 107,834<br>( ー)                     | 6,489                    | 12,097                             |
|     | オランダ     | 18,184<br>( 1,718)        | 73,657<br>( ー)                      | 4,283<br>( ー)            | 9,324<br>( 27)                     |
|     | スペイン     | 32,841<br>( 45,932)       | 26,845<br>( 763)                    | 47,515                   | 4,188                              |
|     | ベルギー     | 1,893                     | 11,350                              | 385                      | 2,521                              |
|     | オーストリア   | 789                       | 3,260                               | 142                      | 675                                |
|     | ルクセンブルク  | 1,632                     | 3,101                               | 937                      | 1,094                              |
|     | フィンランド   | 7,236                     | 11,389                              | 1,893                    | 1,195                              |
|     | アイルランド   | 1,047                     | 6,746                               | 70                       | 322                                |
|     | ポルトガル    | 2,387                     | 1,496                               | ー                        | ー                                  |
|     | イギリス     | 176,276<br>( 3,662)       | 千イギリスポンド<br>106,076<br>( 2,297)     | 24,075<br>( 6,452)       | 千イギリスポンド<br>21,148<br>( 2,339)     |
|     | スイス      | 13,184<br>( 257)          | 千スイスフラン<br>118,991<br>(△ 691)       | 1,974                    | 千スイスフラン<br>18,074                  |
|     | スウェーデン   | 29,131<br>( 10,983)       | 千スウェーデンクローネ<br>534,726<br>( 11,159) | 4,370<br>( 3,058)        | 千スウェーデンクローネ<br>85,716<br>( 18,185) |
|     | ノルウェー    | 5,133                     | 千ノルウェークローネ<br>88,454                | 1,092                    | 千ノルウェークローネ<br>14,932               |
|     | デンマーク    | 3,819                     | 千デンマーククローネ<br>213,956               | 601                      | 千デンマーククローネ<br>35,262               |
|     | オーストラリア  | 53,450<br>( 5,433)        | 千オーストラリアドル<br>139,473<br>( 1,221)   | 11,487<br>(10,478)       | 千オーストラリアドル<br>16,338<br>( 4,086)   |
|     | ニュージーランド | 3,366                     | 千ニュージーランドドル<br>3,301                | 1,153                    | 千ニュージーランドドル<br>704                 |

|            |        | 買 付                    |                                 | 売 付               |                                |
|------------|--------|------------------------|---------------------------------|-------------------|--------------------------------|
|            |        | 株 数                    | 金 額                             | 株 数               | 金 額                            |
| 外<br><br>国 | 香港     | 百株<br>58,203<br>( 915) | 千香港ドル<br>259,747<br>(△ 178)     | 百株<br>19,023      | 千香港ドル<br>34,071                |
|            | シンガポール | 21,158<br>( 9,367)     | 千シンガポールドル<br>16,564<br>( 1,268) | 4,244<br>( 9,367) | 千シンガポールドル<br>2,810<br>( 1,914) |
|            | イスラエル  | 3,822                  | 千イスラエルシェケル<br>18,513            | 747               | 千イスラエルシェケル<br>3,188            |

(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      |
| 外国 | 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    | 50     | 1,716     | 20    | 728     |
|    | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 13     | 2,666     | 1     | 285     |
|    | PROLOGIS INC                 | 53     | 7,434     | 5     | 810     |
|    | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 8      | 1,329     | —     | —       |
|    | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 17     | 2,633     | —     | —       |
|    | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 21     | 1,700     | 9     | 723     |
|    | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 5      | 1,593     | —     | —       |
|    | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 11     | 2,107     | 1     | 353     |
|    | WELLTOWER INC                | 33     | 2,829     | —     | —       |
|    | BOSTON PROPERTIES INC        | 9      | 1,032     | —     | —       |
|    | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 49     | 970       | —     | —       |
|    | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 9      | 1,867     | 1     | 352     |
|    | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 9      | 313       | 47    | 1,317   |
|    | REALTY INCOME CORP           | 40     | 2,737     | —     | —       |
|    |                              | ( 34)  | ( 2,275)  |       |         |
|    | REGENCY CENTERS CORP         | 9      | 683       | 4     | 318     |
|    | SUN COMMUNITIES INC          | 12     | 2,385     | 3     | 721     |
|    | UDR INC                      | 20     | 1,153     | —     | —       |
|    | VENTAS INC                   | 30     | 1,755     | —     | —       |
|    | WEYERHAEUSER CO              | 53     | 2,000     | 8     | 360     |
|    | AMERICAN TOWER CORP          | 34     | 9,083     | 3     | 820     |
|    | WP CAREY INC                 | 12     | 999       | —     | —       |
|    | VEREIT INC                   | 12     | 621       | —     | —       |
|    |                              | (△ 48) | (△ 2,275) |       |         |
|    | DUKE REALTY CORP             | 28     | 1,510     | —     | —       |
|    | IRON MOUNTAIN INC            | 27     | 1,296     | 6     | 306     |
|    | EQUINIX INC                  | 6      | 4,914     | 0.498 | 356     |
|    | CROWN CASTLE INTL CORP       | 32     | 5,743     | 4     | 762     |
|    | EQUITY RESIDENTIAL           | 28     | 2,349     | 9     | 755     |
|    | INVITATION HOMES INC         | 57     | 2,227     | 8     | 353     |
|    | VICI PROPERTIES INC          | 122    | 3,722     | —     | —       |
|    | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 7      | 2,535     | 0.996 | 347     |
|    | ORION OFFICE REIT INC        | —      | —         | 11    | 212     |
|    |                              | ( 11)  | ( —)      |       |         |
|    | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 56     | 981       | —     | —       |
|    | PUBLIC STORAGE               | 11     | 3,902     | 2     | 688     |
|    | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 21     | 3,033     | 2     | 306     |
|    | VORNADO REALTY TRUST         | 7      | 335       | —     | —       |
|    | KIMCO REALTY CORP            | 135    | 3,181     | —     | —       |
|    | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 12     | 2,948     | 2     | 730     |
|    | 小計                           | 1,076  | 88,298    | 156   | 11,615  |
|    |                              | (△ 2)  | ( —)      |       |         |

| 銘柄 |                              | 買付      |            | 売付  |            |
|----|------------------------------|---------|------------|-----|------------|
|    |                              | 口数      | 金額         | 口数  | 金額         |
| 外国 | カナダ                          | 千口      | 千カナダドル     | 千口  | 千カナダドル     |
|    | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 8       | 456        | —   | —          |
|    | 小計                           | 8       | 456        | —   | —          |
|    | ユーロ                          |         | 千ユーロ       |     | 千ユーロ       |
|    | フランス                         |         |            |     |            |
|    | GECINA SA                    | 3       | 510        | 1   | 249        |
|    | KLEPIERRE                    | 24      | 564        | —   | —          |
|    |                              | ( ー)    | (△ 38)     |     |            |
|    | COVIVIO                      | 4       | 302        | —   | —          |
|    | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 7       | 499        | 3   | 224        |
|    | 小計                           | 40      | 1,876      | 5   | 474        |
|    |                              | ( ー)    | (△ 38)     |     |            |
|    | ユーロ計                         | 40      | 1,876      | 5   | 474        |
|    |                              | ( ー)    | (△ 38)     |     |            |
|    | イギリス                         |         | 千イギリスポンド   |     | 千イギリスポンド   |
|    | BRITISH LAND CO PLC          | 42      | 217        | —   | —          |
|    | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 34      | 244        | —   | —          |
|    | SEGRO PLC                    | 73      | 904        | —   | —          |
|    | 小計                           | 150     | 1,365      | —   | —          |
|    | 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             | 566     | 1,009      | 256 | 461        |
|    | SCENTRE GROUP                | 454     | 1,294      | —   | —          |
|    | DEXUS/AU                     | 131     | 1,416      | 47  | 516        |
|    |                              | ( 172)  | ( 1,802)   |     |            |
|    | GPT GROUP                    | 90      | 459        | —   | —          |
|    | MIRVAC GROUP                 | 290     | 836        | —   | —          |
|    | STOCKLAND                    | 178     | 834        | —   | —          |
|    | DEXUS                        | —       | —          | —   | —          |
|    |                              | (△ 172) | (△ 1,802)  |     |            |
|    | GOODMAN GROUP                | 96      | 2,125      | —   | —          |
|    | 小計                           | 1,806   | 7,976      | 303 | 978        |
|    | 香港                           |         | 千香港ドル      |     | 千香港ドル      |
|    | LINK REIT                    | 127     | 8,981      | —   | —          |
|    | 小計                           | 127     | 8,981      | —   | —          |
|    | 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                  | —       | —          | 254 | 361        |
|    | CDL HOSPITALITY TRUSTS       | —       | —          | —   | —          |
|    |                              | ( 18)   | ( 22)      |     |            |
|    | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 226     | 453        | —   | —          |
|    |                              | ( ー)    | (△ 15)     |     |            |
|    | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | —       | —          | —   | —          |
|    |                              | ( ー)    | (△ 2)      |     |            |
|    | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 211     | 446        | —   | —          |
|    |                              | ( 79)   | ( 132)     |     |            |

| 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 |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 149   | 450       | —   | —         |
|     |                              | ( —)  | (△ 17)    |     |           |
|     | 小 計                          | 587   | 1,350     | 254 | 361       |
|     |                              | ( 98) | ( 120)    |     |           |

(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     | 百万円     | 百万円   | 百万円   |
|       |        | 741,257 | 744,969 | —     | —     |

(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

(2021年5月13日～2022年5月12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       | 561,405,953千円   |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 1,239,023,226千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.45            |

(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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等           |                |               | 売付額等           |                |               |
|--------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|
|        | A              | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 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<br>707,260 | 百万円<br>680,861 | %<br>96.3     | 百万円<br>314,672 | 百万円<br>298,244 | %<br>94.8     |

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MUFG証券です。

## ○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

## 外国株式

| 銘柄                           | 株数    | 期首(前期末) | 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         |                        |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 1,130 | 1,514   | 24,136  | 3,132,163  | 各種金融                   |
| ABBOTT LABORATORIES          | 2,922 | 4,064   | 43,014  | 5,581,955  | ヘルスケア機器・サービス           |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 517   | 694     | 7,921   | 1,027,973  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 706   | 968     | 20,190  | 2,620,094  | ソフトウェア・サービス            |
| AES CORP                     | 1,097 | 1,515   | 3,025   | 392,654    | 公益事業                   |
| AFLAC INC                    | 1,119 | 1,420   | 8,081   | 1,048,774  | 保険                     |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 1,449 | 1,909   | 11,192  | 1,452,422  | 保険                     |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 1,984 | 3,760   | 33,058  | 4,290,040  | 半導体・半導体製造装置            |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 1,043 | 1,452   | 40,804  | 5,295,135  | ソフトウェア・サービス            |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 365   | 510     | 11,890  | 1,543,021  | 素材                     |
| ANTHEM INC                   | 409   | 558     | 27,216  | 3,531,900  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 2,356 | 3,272   | 12,676  | 1,645,024  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 845   | 1,167   | 8,405   | 1,090,734  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BOEING CO/THE                | 883   | 1,285   | 16,635  | 2,158,760  | 資本財                    |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 479   | 651     | 16,230  | 2,106,188  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BEST BUY CO INC              | 380   | 521     | 4,366   | 566,603    | 小売                     |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 3,726 | 5,098   | 38,826  | 5,038,557  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                | 251   | 349     | 20,958  | 2,719,825  | 各種金融                   |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 6,821 | 9,501   | 45,490  | 5,903,339  | 電気通信サービス               |
| BALL CORP                    | 533   | 739     | 4,974   | 645,573    | 素材                     |
| ALLSTATE CORP                | 509   | 668     | 8,588   | 1,114,519  | 保険                     |
| EVERETT DENNISON CORP        | 143   | 182     | 3,138   | 407,311    | 素材                     |
| CHUBB LTD                    | 745   | 988     | 20,221  | 2,624,175  | 保険                     |
| ANALOG DEVICES INC           | 609   | 1,231   | 18,713  | 2,428,426  | 半導体・半導体製造装置            |
| AUTOZONE INC                 | 38    | 47      | 9,220   | 1,196,535  | 小売                     |
| CVS HEALTH CORP              | 2,155 | 3,034   | 29,732  | 3,858,337  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CORNING INC                  | 1,242 | 1,834   | 6,398   | 830,327    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 5,022 | 6,790   | 80,228  | 10,411,270 | 銀行                     |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   | —     | 123     | 2,745   | 356,344    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CATERPILLAR INC              | 895   | 1,242   | 25,500  | 3,309,136  | 資本財                    |
| COCA-COLA CO/THE             | 6,726 | 9,426   | 60,623  | 7,867,127  | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 757   | 979     | 11,709  | 1,519,530  | 各種金融                   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 300   | 442     | 2,181   | 283,069    | 食品・飲料・タバコ              |
| CSX CORP                     | 1,259 | 5,096   | 16,903  | 2,193,597  | 運輸                     |
| CHEVRON CORP                 | 3,168 | 4,427   | 72,242  | 9,374,911  | エネルギー                  |
| CONOCOPHILLIPS               | 2,223 | 3,023   | 29,945  | 3,885,993  | エネルギー                  |
| CME GROUP INC                | 591   | 825     | 16,400  | 2,128,286  | 各種金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC          | 500   | 652     | 3,648   | 473,412    | ヘルスケア機器・サービス           |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 1,339 | 1,838   | 14,111  | 1,831,287  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| DOMINION ENERGY INC          | 1,346 | 1,855   | 15,407  | 1,999,390  | 公益事業                   |
| DEVON ENERGY CORP            | 997   | 1,492   | 9,652   | 1,252,649  | エネルギー                  |
| DEERE & CO                   | 491   | 676     | 24,633  | 3,196,695  | 資本財                    |
| DANAHER CORP                 | 1,054 | 1,478   | 35,049  | 4,548,417  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WALT DISNEY CO/THE           | 2,986 | 4,178   | 43,965  | 5,705,371  | メディア・娯楽                |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 207   | 297     | 3,619   | 469,644    | 消費者サービス                |
| DUKE ENERGY CORP             | 1,218 | 1,762   | 19,370  | 2,513,757  | 公益事業                   |

| 銘柄                           | 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         |                        |
| DR HORTON INC                |   | 565     | 769   | 4,992   | 647,906    | 耐久消費財・アパレル             |
| TARGET CORP                  |   | 825     | 1,101 | 23,508  | 3,050,636  | 小売                     |
| DAVITA INC                   |   | 128     | 162   | 1,660   | 215,496    | ヘルスケア機器・サービス           |
| DOVER CORP                   |   | 234     | 336   | 4,381   | 568,635    | 資本財                    |
| DTE ENERGY COMPANY           |   | 314     | 448   | 5,836   | 757,416    | 公益事業                   |
| EXXON MOBIL CORP             |   | 6,962   | 9,724 | 84,397  | 10,952,269 | エネルギー                  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    |   | 1,027   | 1,433 | 13,374  | 1,735,638  | ヘルスケア機器・サービス           |
| EOG RESOURCES INC            |   | 948     | 1,339 | 16,249  | 2,108,677  | エネルギー                  |
| EMERSON ELECTRIC CO          |   | 987     | 1,373 | 11,417  | 1,481,636  | 資本財                    |
| EXELON CORP                  |   | 1,623   | 2,274 | 10,830  | 1,405,437  | 公益事業                   |
| ECOLAB INC                   |   | 423     | 599   | 9,602   | 1,246,116  | 素材                     |
| EQUIFAX INC                  |   | 205     | 289   | 5,548   | 720,033    | 商業・専門サービス              |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  |   | 373     | 532   | 12,214  | 1,585,089  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EATON CORP PLC               |   | 658     | 912   | 12,845  | 1,667,019  | 資本財                    |
| EDISON INTERNATIONAL         |   | 638     | 872   | 5,972   | 775,044    | 公益事業                   |
| ENTERGY CORP                 |   | 341     | 468   | 5,510   | 715,033    | 公益事業                   |
| EVEREST RE GROUP LTD         |   | 65      | 88    | 2,468   | 320,313    | 保険                     |
| NEXTERA ENERGY INC           |   | 3,230   | 4,509 | 31,655  | 4,107,906  | 公益事業                   |
| FEDEX CORP                   |   | 413     | 581   | 12,052  | 1,564,041  | 運輸                     |
| FORD MOTOR CO                |   | 6,466   | 9,033 | 11,589  | 1,504,013  | 自動車・自動車部品              |
| FRANKLIN RESOURCES INC       |   | 466     | 654   | 1,562   | 202,739    | 各種金融                   |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC |   | 59      | 83    | 3,069   | 398,356    | 各種金融                   |
| FIRSTENERGY CORP             |   | 890     | 1,268 | 5,375   | 697,554    | 公益事業                   |
| FREEPORT-MCMORAN INC         |   | 2,410   | 3,379 | 12,136  | 1,575,005  | 素材                     |
| GENERAL MILLS INC            |   | 987     | 1,403 | 10,080  | 1,308,156  | 食品・飲料・タバコ              |
| GENERAL DYNAMICS CORP        |   | 406     | 545   | 12,380  | 1,606,615  | 資本財                    |
| WW GRAINGER INC              |   | 74      | 103   | 4,766   | 618,521    | 資本財                    |
| GENERAL ELECTRIC CO          |   | 14,448  | 2,526 | 18,298  | 2,374,632  | 資本財                    |
| GLOBAL PAYMENTS INC          |   | 493     | 681   | 7,987   | 1,036,576  | ソフトウェア・サービス            |
| GENUINE PARTS CO             |   | 231     | 317   | 4,106   | 532,945    | 小売                     |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      |   | 538     | 773   | 23,331  | 3,027,732  | 各種金融                   |
| HALLIBURTON CO               |   | 1,513   | 2,048 | 7,107   | 922,335    | エネルギー                  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  |   | 1,155   | 1,581 | 30,362  | 3,940,177  | 資本財                    |
| HP INC                       |   | 2,287   | 2,670 | 9,575   | 1,242,661  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  |   | 587     | 768   | 5,362   | 695,921    | 保険                     |
| HERSHEY CO/THE               |   | 250     | 330   | 7,434   | 964,756    | 食品・飲料・タバコ              |
| HOME DEPOT INC               |   | 1,775   | 2,400 | 67,925  | 8,814,678  | 小売                     |
| HASBRO INC                   |   | 204     | 309   | 2,710   | 351,681    | 耐久消費財・アパレル             |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       |   | 403     | 552   | 7,245   | 940,189    | 資本財                    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  |   | 1,467   | 2,060 | 26,944  | 3,496,613  | ソフトウェア・サービス            |
| INTERNATIONAL PAPER CO       |   | 611     | 885   | 4,219   | 547,559    | 素材                     |
| ILLINOIS TOOL WORKS          |   | 524     | 719   | 14,668  | 1,903,547  | 資本財                    |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC |   | 646     | 918   | 2,844   | 369,152    | メディア・娯楽                |
| IDEX CORP                    |   | 131     | 169   | 3,085   | 400,425    | 資本財                    |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    |   | 377     | 578   | 7,408   | 961,352    | 素材                     |
| JOHNSON & JOHNSON            |   | 4,339   | 6,050 | 106,560 | 13,828,344 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KANSAS CITY SOUTHERN         |   | 152     | —     | —       | —          | 運輸                     |
| KELLOGG CO                   |   | 442     | 570   | 4,127   | 535,574    | 食品・飲料・タバコ              |
| KIMBERLY-CLARK CORP          |   | 566     | 781   | 10,850  | 1,408,128  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A |   | 2,354   | 3,201 | 20,989  | 2,723,849  | 食品・飲料・タバコ              |
| KROGER CO                    |   | 1,292   | 1,657 | 9,003   | 1,168,421  | 食品・生活必需品小売り            |
| ELI LILLY & CO               |   | 1,420   | 1,869 | 53,593  | 6,954,871  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘柄                           | 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         |                        |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS |       | 157     | 222    | 5,312   | 689,457    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        |       | 234     | 388    | 1,672   | 217,072    | 運輸                     |
| LENNAR CORP-A                |       | 452     | 633    | 4,516   | 586,161    | 耐久消費財・アパレル             |
| LOWE'S COS INC               | 1,208 | 1,548   | 1,548  | 29,076  | 3,773,265  | 小売                     |
| BATH & BODY WORKS INC        |       | —       | 581    | 2,777   | 360,379    | 小売                     |
| LAS VEGAS SANDS CORP         |       | 560     | 805    | 2,441   | 316,857    | 消費者サービス                |
| LOCKHEED MARTIN CORP         |       | 414     | 570    | 25,140  | 3,262,465  | 資本財                    |
| LINCOLN NATIONAL CORP        |       | 315     | 422    | 2,259   | 293,175    | 保険                     |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     |       | 56      | 76     | 1,602   | 208,016    | 資本財                    |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A |       | 459     | 625    | 10,450  | 1,356,121  | 消費者サービス                |
| MCDONALD'S CORP              | 1,229 | 1,715   | 1,715  | 41,924  | 5,440,496  | 消費者サービス                |
| S&P GLOBAL INC               |       | 396     | 814    | 26,532  | 3,443,185  | 各種金融                   |
| MEDTRONIC PLC                |       | 2,215   | 3,088  | 31,082  | 4,033,593  | ヘルスケア機器・サービス           |
| MERCK & CO. INC.             |       | 4,171   | 5,806  | 51,788  | 6,720,539  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICRON TECHNOLOGY INC        |       | 1,836   | 2,570  | 17,212  | 2,233,627  | 半導体・半導体製造装置            |
| 3M CO                        |       | 950     | 1,322  | 19,357  | 2,512,035  | 資本財                    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       |       | 276     | 388    | 7,843   | 1,017,803  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    |       | 753     | 899    | 3,153   | 409,269    | 消費者サービス                |
| MASCO CORP                   |       | 427     | 535    | 2,802   | 363,689    | 資本財                    |
| M & T BANK CORP              |       | 211     | 420    | 6,917   | 897,622    | 銀行                     |
| MARSH & MCLENNAN COS         |       | 835     | 1,158  | 18,101  | 2,349,089  | 保険                     |
| MOLINA HEALTHCARE INC        |       | 102     | 129    | 3,726   | 483,587    | ヘルスケア機器・サービス           |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        |       | 105     | 124    | 1,701   | 220,752    | 耐久消費財・アパレル             |
| MORGAN STANLEY               |       | 2,318   | 3,090  | 24,384  | 3,164,366  | 各種金融                   |
| MCKESSON CORP                |       | 269     | 347    | 11,537  | 1,497,260  | ヘルスケア機器・サービス           |
| METLIFE INC                  |       | 1,277   | 1,614  | 10,349  | 1,343,027  | 保険                     |
| MOODY'S CORP                 |       | 279     | 386    | 10,904  | 1,415,085  | 各種金融                   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        |       | 418     | 559    | 13,784  | 1,788,788  | 運輸                     |
| BANK OF AMERICA CORP         |       | 12,829  | 16,923 | 60,198  | 7,811,898  | 銀行                     |
| NISOURCE INC                 |       | 601     | 840    | 2,494   | 323,746    | 公益事業                   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        |       | 261     | 346    | 15,470  | 2,007,610  | 資本財                    |
| NEWMONT CORP                 |       | 1,331   | 1,839  | 12,587  | 1,633,524  | 素材                     |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  |       | 419     | 581    | 5,708   | 740,755    | 食品・飲料・タバコ              |
| MARKEL CORP                  |       | 21      | 30     | 3,895   | 505,549    | 保険                     |
| NUCOR CORP                   |       | 506     | 642    | 8,094   | 1,050,368  | 素材                     |
| NEWELL BRANDS INC            |       | 656     | 804    | 1,753   | 227,611    | 耐久消費財・アパレル             |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    |       | 1,588   | 2,144  | 12,888  | 1,672,525  | エネルギー                  |
| OMNICOM GROUP                |       | 346     | 473    | 3,539   | 459,354    | メディア・娯楽                |
| PEPSICO INC                  |       | 2,274   | 3,175  | 54,200  | 7,033,588  | 食品・飲料・タバコ              |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    |       | 165     | 217    | 3,450   | 447,720    | 素材                     |
| ALTRIA GROUP INC             |       | 3,065   | 4,215  | 21,789  | 2,827,577  | 食品・飲料・タバコ              |
| PINNACLE WEST CAPITAL        |       | 185     | —      | —       | —          | 公益事業                   |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      |       | 4,086   | 5,557  | 84,812  | 11,006,065 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP |       | 696     | 967    | 15,469  | 2,007,451  | 銀行                     |
| PFIZER INC                   |       | 9,166   | 12,903 | 63,808  | 8,280,416  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     |       | 667     | 855    | 8,814   | 1,143,895  | 保険                     |
| PULTEGROUP INC               |       | 462     | 610    | 2,471   | 320,738    | 耐久消費財・アパレル             |
| PARKER HANNIFIN CORP         |       | 216     | 295    | 7,832   | 1,016,427  | 資本財                    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO |       | 342     | 535    | 13,379  | 1,736,262  | エネルギー                  |
| CITIGROUP INC                |       | 3,429   | 4,555  | 21,713  | 2,817,793  | 銀行                     |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    |       | 446     | 603    | 4,110   | 533,469    | 保険                     |
| PPG INDUSTRIES INC           |       | 383     | 550    | 6,841   | 887,850    | 素材                     |

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末)<br>株 数 | 当<br>株 数 | 期 末     |            | 業 種 等                  |
|------------------------------|----------------|----------|---------|------------|------------------------|
|                              |                |          | 評 価 額   |            |                        |
|                              |                |          | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |
| (アメリカ)                       | 百株             | 百株       | 千アメリカドル | 千円         |                        |
| PENTAIR PLC                  | 269            | 363      | 1,770   | 229,763    | 資本財                    |
| P G & E CORP                 | 2,356          | 3,292    | 3,960   | 513,957    | 公益事業                   |
| PPL CORP                     | 1,308          | 1,677    | 4,763   | 618,218    | 公益事業                   |
| PROGRESSIVE CORP             | 967            | 1,344    | 14,503  | 1,882,056  | 保険                     |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 825            | 1,182    | 8,154   | 1,058,246  | 公益事業                   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 368            | 549      | 3,291   | 427,104    | 消費者サービス                |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 380            | 503      | 6,501   | 843,740    | 商業・専門サービス              |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 1,636          | 2,263    | 4,531   | 588,090    | 銀行                     |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD   | 82             | —        | —       | —          | 保険                     |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 174            | 244      | 10,492  | 1,361,613  | ソフトウェア・サービス            |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 884            | 1,428    | 4,343   | 563,599    | 公益事業                   |
| ROBERT HALF INTL INC         | 178            | 274      | 2,567   | 333,140    | 商業・専門サービス              |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 189            | 272      | 5,417   | 703,064    | 資本財                    |
| SCHLUMBERGER LTD             | 2,323          | 3,232    | 12,402  | 1,609,525  | エネルギー                  |
| STRYKER CORP                 | 557            | 778      | 17,640  | 2,289,253  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 2,523          | 3,330    | 21,689  | 2,814,623  | 各種金融                   |
| SEMPRA ENERGY                | 468            | 741      | 11,777  | 1,528,339  | 公益事業                   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 404            | 572      | 15,165  | 1,967,970  | 素材                     |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 261            | 367      | 4,366   | 566,688    | 資本財                    |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 425            | 570      | 9,834   | 1,276,283  | 保険                     |
| SOUTHERN CO/THE              | 1,745          | 2,426    | 17,952  | 2,329,686  | 公益事業                   |
| AT&T INC                     | 11,750         | 16,394   | 31,853  | 4,133,664  | 電気通信サービス               |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 515            | 739      | 4,124   | 535,228    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| STATE STREET CORP            | 569            | 854      | 5,665   | 735,266    | 各種金融                   |
| SYSCO CORP                   | 813            | 1,168    | 9,821   | 1,274,479  | 食品・生活必需品小売り            |
| SEALED AIR CORP              | 243            | 351      | 2,206   | 286,293    | 素材                     |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 1,513          | 2,121    | 34,939  | 4,534,160  | 半導体・半導体製造装置            |
| TERADYNE INC                 | 270            | 364      | 3,657   | 474,620    | 半導体・半導体製造装置            |
| GLOBE LIFE INC               | 154            | 225      | 2,194   | 284,787    | 保険                     |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 1,207          | 1,642    | 8,383   | 1,087,981  | 資本財                    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 653            | 905      | 47,109  | 6,113,454  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXTRON INC                  | 362            | 500      | 3,113   | 404,006    | 資本財                    |
| UNION PACIFIC CORP           | 1,110          | 1,477    | 33,074  | 4,292,044  | 運輸                     |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP   | 2,502          | 3,441    | 31,314  | 4,063,678  | 資本財                    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 1,562          | 2,165    | 105,288 | 13,663,341 | ヘルスケア機器・サービス           |
| US BANCORP                   | 2,233          | 3,231    | 15,661  | 2,032,398  | 銀行                     |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 1,179          | 1,676    | 29,747  | 3,860,394  | 運輸                     |
| VALERO ENERGY CORP           | 689            | 942      | 11,344  | 1,472,194  | エネルギー                  |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B     | 916            | 1,404    | 3,748   | 486,432    | メディア・娯楽                |
| VF CORP                      | 543            | 782      | 3,549   | 460,675    | 耐久消費財・アパレル             |
| VULCAN MATERIALS CO          | 215            | 306      | 4,839   | 628,014    | 素材                     |
| WILLIAMS COS INC             | 1,968          | 2,803    | 9,660   | 1,253,707  | エネルギー                  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,238          | 1,653    | 7,169   | 930,428    | 食品・生活必需品小売り            |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 512            | 712      | 7,252   | 941,214    | 公益事業                   |
| WALMART INC                  | 2,335          | 3,526    | 52,059  | 6,755,821  | 食品・生活必需品小売り            |
| WELLS FARGO & CO             | 6,470          | 9,160    | 38,997  | 5,060,719  | 銀行                     |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 696            | 957      | 15,114  | 1,961,372  | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                  | 98             | 145      | 4,532   | 588,178    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WHIRLPOOL CORP               | 99             | 143      | 2,541   | 329,787    | 耐久消費財・アパレル             |
| XCEL ENERGY INC              | 850            | 1,240    | 9,173   | 1,190,411  | 公益事業                   |
| KEYCORP                      | 1,659          | 2,123    | 3,944   | 511,920    | 銀行                     |
| CARMAX INC                   | 266            | 390      | 3,502   | 454,534    | 小売                     |

| 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         |                        |        |   |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC  |   | 335     |   | 473    |   | 5,366   |   | 696,406    | ヘルスケア機器・サービス           |        |   |
| YUM! BRANDS INC             |   | 491     |   | 659    |   | 7,185   |   | 932,525    | 消費者サービス                |        |   |
| TJX COMPANIES INC           |   | 1,977   |   | 2,763  |   | 15,198  |   | 1,972,290  | 小売                     |        |   |
| CLOROX COMPANY              |   | 203     |   | 293    |   | 4,548   |   | 590,265    | 家庭用品・パーソナル用品           |        |   |
| CELANESE CORP               |   | 188     |   | 250    |   | 3,549   |   | 460,646    | 素材                     |        |   |
| CADENCE DESIGN SYS INC      |   | 466     |   | 627    |   | 8,520   |   | 1,105,678  | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| CARNIVAL CORP               |   | 1,253   |   | 2,023  |   | 2,741   |   | 355,786    | 消費者サービス                |        |   |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV |   | 1,022   |   | 1,407  |   | 13,148  |   | 1,706,269  | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| CONAGRA BRANDS INC          |   | 830     |   | 1,078  |   | 3,850   |   | 499,631    | 食品・飲料・タバコ              |        |   |
| CONSOLIDATED EDISON INC     |   | 540     |   | 820    |   | 7,733   |   | 1,003,564  | 公益事業                   |        |   |
| FIFTH THIRD BANCORP         |   | 1,192   |   | 1,587  |   | 5,691   |   | 738,625    | 銀行                     |        |   |
| INTEL CORP                  |   | 6,757   |   | 9,347  |   | 40,035  |   | 5,195,380  | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| CISCO SYSTEMS INC           |   | 6,958   |   | 9,692  |   | 47,152  |   | 6,119,037  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |        |   |
| CINTAS CORP                 |   | 143     |   | 216    |   | 8,028   |   | 1,041,922  | 商業・専門サービス              |        |   |
| COSTCO WHOLESALE CORP       |   | 726     |   | 1,015  |   | 49,677  |   | 6,446,689  | 食品・生活必需品小売り            |        |   |
| APPLIED MATERIALS INC       |   | 1,508   |   | 2,081  |   | 21,629  |   | 2,806,886  | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| ELECTRONIC ARTS INC         |   | 482     |   | 637    |   | 7,675   |   | 996,012    | メディア・娯楽                |        |   |
| TYSON FOODS INC-CL A        |   | 478     |   | 681    |   | 6,144   |   | 797,385    | 食品・飲料・タバコ              |        |   |
| NORTONLIFELOCK INC          |   | 981     |   | 1,304  |   | 3,175   |   | 412,057    | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| ROSS STORES INC             |   | 593     |   | 836    |   | 7,346   |   | 953,338    | 小売                     |        |   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC    |   | 434     |   | 1,251  |   | 8,079   |   | 1,048,425  | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| NIKE INC -CL B              |   | 2,068   |   | 2,934  |   | 31,673  |   | 4,110,318  | 耐久消費財・アパレル             |        |   |
| EXACT SCIENCES CORP         |   | 258     |   | 384    |   | 1,854   |   | 240,645    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| AMGEN INC                   |   | 959     |   | 1,296  |   | 31,200  |   | 4,048,847  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| NORTHERN TRUST CORP         |   | 322     |   | 457    |   | 4,661   |   | 604,892    | 各種金融                   |        |   |
| MICROSOFT CORP              |   | 11,841  |   | 16,399 |   | 427,284 |   | 55,448,681 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| ANSYS INC                   |   | 139     |   | 195    |   | 4,672   |   | 606,391    | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| CENTENE CORP                |   | 943     |   | 1,345  |   | 10,851  |   | 1,408,204  | ヘルスケア機器・サービス           |        |   |
| STARBUCKS CORP              |   | 1,936   |   | 2,696  |   | 18,889  |   | 2,451,309  | 消費者サービス                |        |   |
| ORACLE CORP                 |   | 3,225   |   | 3,770  |   | 26,784  |   | 3,475,823  | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| NETFLIX INC                 |   | 728     |   | 1,019  |   | 16,964  |   | 2,201,537  | メディア・娯楽                |        |   |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC     |   | 121     |   | 152    |   | 9,256   |   | 1,201,272  | 小売                     |        |   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC     |   | 1,275   |   | 1,792  |   | 13,887  |   | 1,802,121  | メディア・娯楽                |        |   |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC      |   | 270     |   | 381    |   | 3,784   |   | 491,087    | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| HENRY SCHEIN INC            |   | 229     |   | 313    |   | 2,650   |   | 343,903    | ヘルスケア機器・サービス           |        |   |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY      |   | 188     |   | 265    |   | 5,086   |   | 660,074    | 小売                     |        |   |
| POOL CORP                   |   | 65      |   | 95     |   | 3,647   |   | 473,375    | 小売                     |        |   |
| LAM RESEARCH CORP           |   | 238     |   | 325    |   | 14,535  |   | 1,886,309  | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| COPART INC                  |   | 342     |   | 479    |   | 5,127   |   | 665,409    | 商業・専門サービス              |        |   |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC  |   | 143     |   | 202    |   | 1,658   |   | 215,252    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| WYNN RESORTS LTD            |   | 165     |   | 222    |   | 1,311   |   | 170,205    | 消費者サービス                |        |   |
| COMCAST CORP-CLASS A        |   | 7,529   |   | 10,474 |   | 41,731  |   | 5,415,541  | メディア・娯楽                |        |   |
| XILINX INC                  |   | 395     |   | —      |   | —       |   | —          | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| PACCAR INC                  |   | 560     |   | 783    |   | 6,469   |   | 839,560    | 資本財                    |        |   |
| DENTSPLY SIRONA INC         |   | 343     |   | 518    |   | 1,953   |   | 253,444    | ヘルスケア機器・サービス           |        |   |
| ALIGN TECHNOLOGY INC        |   | 124     |   | 171    |   | 4,397   |   | 570,684    | ヘルスケア機器・サービス           |        |   |
| GILEAD SCIENCES INC         |   | 2,067   |   | 2,891  |   | 17,509  |   | 2,272,219  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| CITRIX SYSTEMS INC          |   | 201     |   | 298    |   | 2,984   |   | 387,309    | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| INTUITIVE SURGICAL INC      |   | 193     |   | 820    |   | 17,300  |   | 2,245,101  | ヘルスケア機器・サービス           |        |   |
| INTUIT INC                  |   | 432     |   | 619    |   | 22,049  |   | 2,861,306  | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| SVB FINANCIAL GROUP         |   | 87      |   | 134    |   | 5,927   |   | 769,264    | 銀行                     |        |   |
| PAYCHEX INC                 |   | 520     |   | 745    |   | 8,809   |   | 1,143,211  | ソフトウェア・サービス            |        |   |

| 銘柄                           | 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         |                        |
| ON SEMICONDUCTOR             |   | 675     | 980   | 5,078   | 659,034    | 半導体・半導体製造装置            |
| SIGNATURE BANK               |   | —       | 147   | 2,861   | 371,360    | 銀行                     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    |   | 181     | 234   | 2,871   | 372,602    | ソフトウェア・サービス            |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    |   | 158     | 220   | 5,976   | 775,628    | 運輸                     |
| AUTODESK INC                 |   | 363     | 510   | 9,217   | 1,196,211  | ソフトウェア・サービス            |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         |   | 237     | 344   | 756     | 98,118     | 電気通信サービス               |
| SALESFORCE INC               |   | 1,500   | 2,253 | 36,334  | 4,715,184  | ソフトウェア・サービス            |
| ALPHABET INC-CL A            |   | 668     | 691   | 157,141 | 20,392,290 | メディア・娯楽                |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A |   | 89      | 122   | 3,857   | 500,567    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     |   | 61      | 85    | 2,168   | 281,466    | 各種金融                   |
| GARMIN LTD                   |   | 235     | 362   | 3,554   | 461,230    | 耐久消費財・アパレル             |
| TRIMBLE INC                  |   | 425     | 599   | 3,690   | 478,965    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| QUALCOMM INC                 |   | 1,865   | 2,574 | 34,061  | 4,420,151  | 半導体・半導体製造装置            |
| HOLOGIC INC                  |   | 421     | 563   | 4,143   | 537,646    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SYNOPSYS INC                 |   | 253     | 355   | 9,262   | 1,202,040  | ソフトウェア・サービス            |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    |   | 437     | —     | —       | —          | 半導体・半導体製造装置            |
| AMAZON.COM INC               |   | 703     | 1,049 | 221,167 | 28,700,893 | 小売                     |
| T ROWE PRICE GROUP INC       |   | 380     | 520   | 5,974   | 775,344    | 各種金融                   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        |   | 231     | 287   | 3,815   | 495,185    | ヘルスケア機器・サービス           |
| KLA CORP                     |   | 257     | 350   | 10,929  | 1,418,319  | 半導体・半導体製造装置            |
| STEEL DYNAMICS INC           |   | 373     | 470   | 3,548   | 460,458    | 素材                     |
| CERNER CORP                  |   | 498     | 655   | 6,156   | 798,908    | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERISIGN INC                 |   | 165     | 239   | 3,991   | 518,024    | ソフトウェア・サービス            |
| WASTE CONNECTIONS INC        |   | 439     | 607   | 7,457   | 967,724    | 商業・専門サービス              |
| EBAY INC                     |   | 1,138   | 1,417 | 6,602   | 856,840    | 小売                     |
| NVIDIA CORP                  |   | 1,020   | 5,748 | 95,589  | 12,404,701 | 半導体・半導体製造装置            |
| DOLLAR TREE INC              |   | 383     | 524   | 8,188   | 1,062,604  | 小売                     |
| BOOKING HOLDINGS INC         |   | 67      | 94    | 19,559  | 2,538,174  | 消費者サービス                |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  |   | 2,258   | 2,994 | 93,299  | 12,107,500 | 各種金融                   |
| TRUIST FINANCIAL CORP        |   | 2,223   | 3,071 | 14,388  | 1,867,168  | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP |   | 1,296   | 1,840 | 7,807   | 1,013,168  | 各種金融                   |
| BORGWARNER INC               |   | 396     | 544   | 1,963   | 254,854    | 自動車・自動車部品              |
| JM SMUCKER CO/THE            |   | 184     | 260   | 3,757   | 487,647    | 食品・飲料・タバコ              |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       |   | 262     | 345   | 5,574   | 723,343    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ASSURANT INC                 |   | 106     | 126   | 2,290   | 297,300    | 保険                     |
| AMEREN CORPORATION           |   | 419     | 594   | 5,549   | 720,149    | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      |   | 827     | 1,167 | 11,652  | 1,512,184  | 公益事業                   |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    |   | 905     | 1,283 | 10,824  | 1,404,638  | 食品・飲料・タバコ              |
| HESS CORP                    |   | 474     | 631   | 6,930   | 899,405    | エネルギー                  |
| JUNIPER NETWORKS INC         |   | 554     | 777   | 2,376   | 308,384    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| F5 INC                       |   | 96      | 149   | 2,451   | 318,187    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DISH NETWORK CORP-A          |   | 405     | 578   | 1,010   | 131,111    | メディア・娯楽                |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      |   | 266     | 359   | 3,526   | 457,578    | ソフトウェア・サービス            |
| PLUG POWER INC               |   | 752     | 1,228 | 1,652   | 214,403    | 資本財                    |
| NETAPP INC                   |   | 365     | 532   | 3,716   | 482,255    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| INCYTE CORP                  |   | 307     | 442   | 3,272   | 424,626    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ENTEGRIS INC                 |   | —       | 298   | 3,026   | 392,777    | 半導体・半導体製造装置            |
| BIOGEN INC                   |   | 256     | 334   | 6,387   | 828,877    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ILLUMINA INC                 |   | 241     | 337   | 7,184   | 932,273    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADOBE INC                    |   | 790     | 1,094 | 41,535  | 5,390,061  | ソフトウェア・サービス            |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   |   | 431     | 586   | 13,779  | 1,788,161  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   |   | 1,722   | 2,741 | 2,023   | 262,535    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘柄                           | 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         |                        |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   |   | 882     | 1,220  | 8,837   | 1,146,779  | ソフトウェア・サービス            |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     |   | 280     | 400    | 4,325   | 561,353    | 運輸                     |
| FASTENAL CO                  |   | 973     | 1,352  | 6,841   | 887,815    | 資本財                    |
| FISERV INC                   |   | 943     | 1,371  | 12,695  | 1,647,530  | ソフトウェア・サービス            |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       |   | 1,738   | 2,289  | 1,378   | 178,850    | メディア・娯楽                |
| APPLE INC                    |   | 28,033  | 37,718 | 552,580 | 71,708,380 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    |   | 250     | 364    | 4,561   | 591,909    | 保険                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    |   | 1,676   | 3,444  | 4,402   | 571,331    | 銀行                     |
| COSTAR GROUP INC             |   | 66      | 881    | 4,779   | 620,194    | 商業・専門サービス              |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  |   | 355     | —      | —       | —          | 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 |   | 217     | 285    | 3,088   | 400,781    | 運輸                     |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       |   | 1,510   | 1,975  | 2,095   | 271,958    | 電気通信サービス               |
| ONEOK INC                    |   | 726     | 1,004  | 6,204   | 805,158    | エネルギー                  |
| SEAGATE TECHNOLOGY           |   | 381     | —      | —       | —          | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| BUNGE LTD                    |   | 216     | 321    | 3,524   | 457,331    | 食品・飲料・タバコ              |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       |   | 109     | 140    | 2,824   | 366,526    | 小売                     |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   |   | 281     | 374    | 9,219   | 1,196,454  | 食品・飲料・タバコ              |
| NVR INC                      |   | 6       | 7      | 3,165   | 410,782    | 耐久消費財・アパレル             |
| COOPER COS INC/THE           |   | 86      | 117    | 3,709   | 481,383    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMPHENOL CORP-CL A           |   | 998     | 1,347  | 9,213   | 1,195,579  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WR BERKLEY CORP              |   | 232     | 479    | 3,196   | 414,867    | 保険                     |
| DISCOVERY INC - A            |   | 255     | —      | —       | —          | メディア・娯楽                |
| MONSTER BEVERAGE CORP        |   | 665     | 927    | 7,877   | 1,022,255  | 食品・飲料・タバコ              |
| EXPEDIA GROUP INC            |   | 219     | 329    | 4,383   | 568,843    | 消費者サービス                |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   |   | 361     | 478    | 4,575   | 593,826    | 素材                     |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        |   | 596     | 829    | 1,900   | 246,650    | 電気通信サービス               |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     |   | 189     | 257    | 6,602   | 856,780    | 各種金融                   |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  |   | 443     | 656    | 2,605   | 338,083    | 保険                     |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN |   | 925     | 1,294  | 12,241  | 1,588,577  | 各種金融                   |
| NASDAQ INC                   |   | 196     | 267    | 3,834   | 497,647    | 各種金融                   |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN |   | 270     | 371    | 3,127   | 405,881    | メディア・娯楽                |
| AUTOLIV INC                  |   | 129     | —      | —       | —          | 自動車・自動車部品              |
| CBRE GROUP INC - A           |   | 542     | 752    | 5,879   | 763,030    | 不動産                    |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   |   | 44      | 65     | 8,455   | 1,097,245  | 消費者サービス                |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    |   | 501     | 733    | 4,760   | 617,807    | 食品・飲料・タバコ              |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC |   | 73      | 102    | 3,951   | 512,773    | 半導体・半導体製造装置            |
| ARROW ELECTRONICS INC        |   | 122     | 150    | 1,860   | 241,414    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| BROWN & BROWN INC            |   | 383     | 547    | 3,070   | 398,477    | 保険                     |
| CUMMINS INC                  |   | 248     | 327    | 6,417   | 832,842    | 資本財                    |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC |   | 211     | 286    | 3,745   | 486,025    | 商業・専門サービス              |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    |   | 105     | 144    | 4,649   | 603,357    | 素材                     |
| ALLIANT ENERGY CORP          |   | 415     | 585    | 3,409   | 442,447    | 公益事業                   |
| MASTERCARD INC - A           |   | 1,466   | 2,017  | 65,732  | 8,530,154  | ソフトウェア・サービス            |
| WESTERN UNION CO             |   | 670     | 830    | 1,372   | 178,092    | ソフトウェア・サービス            |
| LEIDOS HOLDINGS INC          |   | 218     | 313    | 3,168   | 411,173    | 商業・専門サービス              |
| AERCAP HOLDINGS NV           |   | —       | 293    | 1,259   | 163,461    | 資本財                    |
| IPG PHOTONICS CORP           |   | 57      | 101    | 954     | 123,808    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MOSAIC CO/THE                |   | 635     | 878    | 5,222   | 677,722    | 素材                     |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   |   | 333     | 647    | 289     | 37,630     | 消費者サービス                |
| HEICO CORP                   |   | 72      | 96     | 1,285   | 166,870    | 資本財                    |
| TRANSDIGM GROUP INC          |   | 84      | 123    | 7,026   | 911,787    | 資本財                    |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO |   | 189     | 276    | 3,731   | 484,270    | ソフトウェア・サービス            |

| 銘柄                           | 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    | 千円     |           |                        |
| INSULET CORP                 |   | 112     | 160   | 2,996  | 388,791   | ヘルスケア機器・サービス           |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     |   | 212     | 290   | 5,866  | 761,245   | 保険                     |
| BLACKSTONE INC               |   | 1,113   | 1,578 | 15,267 | 1,981,298 | 各種金融                   |
| TE CONNECTIVITY LTD          |   | 549     | 747   | 9,121  | 1,183,694 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  |   | 511     | 671   | 7,030  | 912,403   | 各種金融                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC      |   | 206     | 269   | 7,863  | 1,020,427 | 耐久消費財・アパレル             |
| MERCADOLIBRE INC             |   | 74      | 105   | 7,163  | 929,561   | 小売                     |
| VMWARE INC-CLASS A           |   | 132     | 494   | 4,858  | 630,516   | ソフトウェア・サービス            |
| LOEWS CORP                   |   | 400     | 511   | 3,193  | 414,385   | 保険                     |
| SEAGEN INC                   |   | 204     | 317   | 3,796  | 492,715   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MASIMO CORP                  |   | 85      | 135   | 1,659  | 215,295   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ULTA BEAUTY INC              |   | 91      | 122   | 4,586  | 595,201   | 小売                     |
| LKQ CORP                     |   | 460     | 658   | 3,211  | 416,775   | 小売                     |
| HORMEL FOODS CORP            |   | 472     | 683   | 3,568  | 463,117   | 食品・飲料・タバコ              |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      |   | 370     | 576   | 2,488  | 322,964   | 公益事業                   |
| EASTMAN CHEMICAL CO          |   | 223     | 310   | 3,162  | 410,430   | 素材                     |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    |   | 350     | 454   | 10,833 | 1,405,854 | 資本財                    |
| HUMANA INC                   |   | 218     | 296   | 12,786 | 1,659,254 | ヘルスケア機器・サービス           |
| NRG ENERGY INC               |   | 395     | 549   | 2,297  | 298,155   | 公益事業                   |
| INVESCO LTD                  |   | 622     | 733   | 1,250  | 162,268   | 各種金融                   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  |   | 288     | 410   | 3,105  | 403,043   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      |   | 198     | 253   | 1,356  | 176,011   | 各種金融                   |
| MSCI INC                     |   | 137     | 185   | 7,197  | 934,070   | 各種金融                   |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B |   | 322     | 463   | 2,587  | 335,719   | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  |   | 2,568   | 3,576 | 37,058 | 4,809,101 | 食品・飲料・タバコ              |
| VISA INC-CLASS A SHARES      |   | 2,788   | 3,839 | 75,526 | 9,801,126 | ソフトウェア・サービス            |
| KEURIG DR PEPPER INC         |   | 905     | 1,622 | 6,072  | 788,054   | 食品・飲料・タバコ              |
| COTERRA ENERGY INC           |   | 683     | 1,728 | 5,114  | 663,674   | エネルギー                  |
| T-MOBILE US INC              |   | 924     | 1,435 | 17,692 | 2,296,007 | 電気通信サービス               |
| DISCOVERY INC-C              |   | 496     | —     | —      | —         | メディア・娯楽                |
| RESMED INC                   |   | 241     | 338   | 6,474  | 840,209   | ヘルスケア機器・サービス           |
| GARTNER INC                  |   | 144     | 183   | 4,493  | 583,088   | ソフトウェア・サービス            |
| AMETEK INC                   |   | 374     | 520   | 6,269  | 813,656   | 資本財                    |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       |   | 653     | 895   | 4,094  | 531,364   | 保険                     |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       |   | 422     | 576   | 5,630  | 730,729   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  |   | 132     | 188   | 3,202  | 415,573   | 運輸                     |
| FMC CORP                     |   | 204     | 292   | 3,383  | 439,124   | 素材                     |
| WABTEC CORP                  |   | 291     | 405   | 3,412  | 442,804   | 資本財                    |
| EVERSOURCE ENERGY            |   | 558     | 775   | 6,926  | 898,908   | 公益事業                   |
| CROWN HOLDINGS INC           |   | 224     | 287   | 2,908  | 377,421   | 素材                     |
| DELTA AIR LINES INC          |   | 253     | 329   | 1,248  | 162,029   | 運輸                     |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  |   | 292     | 409   | 5,893  | 764,842   | 公益事業                   |
| VERISK ANALYTICS INC         |   | 252     | 343   | 5,998  | 778,401   | 商業・専門サービス              |
| DOLLAR GENERAL CORP          |   | 411     | 537   | 12,275 | 1,593,030 | 小売                     |
| FORTINET INC                 |   | 223     | 314   | 8,214  | 1,066,029 | ソフトウェア・サービス            |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL |   | 39      | 51    | 6,115  | 793,568   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GENERAL MOTORS CO            |   | 2,130   | 3,009 | 11,215 | 1,455,398 | 自動車・自動車部品              |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        |   | 461     | 621   | 10,615 | 1,377,591 | 半導体・半導体製造装置            |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     |   | 431     | 606   | 6,512  | 845,102   | 素材                     |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE |   | 64      | 97    | 2,007  | 260,493   | 資本財                    |
| NORDSON CORP                 |   | 87      | 114   | 2,373  | 307,997   | 資本財                    |
| HCA HEALTHCARE INC           |   | 448     | 572   | 11,990 | 1,556,015 | ヘルスケア機器・サービス           |

| 銘柄                            | 柄 | 期首(前期末) | 当 期   |         | 業 種 等      |                        |
|-------------------------------|---|---------|-------|---------|------------|------------------------|
|                               |   | 株 数     | 株 数   | 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         |                        |
| MARATHON PETROLEUM CORP       |   | 1,057   | 1,410 | 12,973  | 1,683,515  | エネルギー                  |
| ZILLOW GROUP INC - A          |   | 98      | 118   | 411     | 53,443     | 不動産                    |
| ATMOS ENERGY CORP             |   | 204     | 304   | 3,434   | 445,660    | 公益事業                   |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI  |   | 240     | 318   | 2,118   | 274,888    | 資本財                    |
| DEXCOM INC                    |   | 161     | 226   | 7,138   | 926,394    | ヘルスケア機器・サービス           |
| XYLEM INC                     |   | 296     | 430   | 3,481   | 451,805    | 資本財                    |
| ABIOMED INC                   |   | 74      | 105   | 2,453   | 318,392    | ヘルスケア機器・サービス           |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC      |   | 90      | 152   | 2,184   | 283,486    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA        |   | 280     | 397   | 5,541   | 719,057    | 銀行                     |
| ALLEGHANY CORP                |   | 23      | 32    | 2,716   | 352,471    | 保険                     |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     |   | 173     | 243   | 14,940  | 1,938,767  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILLIPS 66                   |   | 736     | 1,117 | 10,191  | 1,322,611  | エネルギー                  |
| META PLATFORMS INC-CLASS A    |   | 3,962   | 5,441 | 102,698 | 13,327,212 | メディア・娯楽                |
| CMS ENERGY CORP               |   | 492     | 657   | 4,510   | 585,319    | 公益事業                   |
| ALBEMARLE CORP                |   | 182     | 266   | 5,668   | 735,603    | 素材                     |
| KINDER MORGAN INC             |   | 3,387   | 4,746 | 8,790   | 1,140,747  | エネルギー                  |
| APTIV PLC                     |   | 451     | 620   | 5,625   | 730,082    | 自動車・自動車部品              |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING  |   | 258     | 378   | 1,624   | 210,845    | 資本財                    |
| SPLUNK INC                    |   | 258     | 382   | 3,366   | 436,869    | ソフトウェア・サービス            |
| HEICO CORP-CLASS A            |   | 116     | 164   | 1,770   | 229,737    | 資本財                    |
| OGE ENERGY CORP               |   | 317     | —     | —       | —          | 公益事業                   |
| ABBVIE INC                    |   | 2,911   | 4,065 | 61,779  | 8,017,084  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC     |   | 59      | 110   | 4,286   | 556,293    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC      |   | 115     | —     | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TESLA INC                     |   | 1,250   | 1,962 | 144,069 | 18,695,901 | 自動車・自動車部品              |
| CHENIERE ENERGY INC           |   | 364     | 543   | 7,210   | 935,694    | エネルギー                  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   |   | 211     | 419   | 3,902   | 506,452    | 各種金融                   |
| ZOETIS INC                    |   | 784     | 1,088 | 17,397  | 2,257,665  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES  |   | 126     | 166   | 4,840   | 628,172    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWS CORP - CLASS A           |   | 617     | 871   | 1,472   | 191,077    | メディア・娯楽                |
| SNAP-ON INC                   |   | 84      | 128   | 2,702   | 350,661    | 資本財                    |
| PERKINELMER INC               |   | 177     | 268   | 3,821   | 495,851    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIO-TECHNE CORP               |   | —       | 94    | 3,191   | 414,177    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TWITTER INC                   |   | 1,319   | 1,842 | 8,490   | 1,101,856  | メディア・娯楽                |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   |   | 118     | 175   | 3,118   | 404,734    | ソフトウェア・サービス            |
| WORKDAY INC-CLASS A           |   | 299     | 450   | 7,800   | 1,012,222  | ソフトウェア・サービス            |
| SERVICENOW INC                |   | 321     | 458   | 19,276  | 2,501,559  | ソフトウェア・サービス            |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B   |   | 124     | 170   | 2,077   | 269,567    | ヘルスケア機器・サービス           |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC     |   | 141     | 171   | 3,898   | 505,859    | ソフトウェア・サービス            |
| ALLEGION PLC                  |   | 146     | 192   | 2,092   | 271,586    | 資本財                    |
| ALPHABET INC-CL C             |   | 316     | 657   | 149,845 | 19,445,390 | メディア・娯楽                |
| UNITED RENTALS INC            |   | 118     | 166   | 4,663   | 605,192    | 資本財                    |
| VOYA FINANCIAL INC            |   | 195     | —     | —       | —          | 各種金融                   |
| IQVIA HOLDINGS INC            |   | 321     | 432   | 8,692   | 1,128,028  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLY FINANCIAL INC            |   | 616     | 809   | 3,132   | 406,522    | 各種金融                   |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  |   | 462     | 637   | 8,581   | 1,113,634  | 消費者サービス                |
| DIAMONDBACK ENERGY INC        |   | —       | 403   | 5,052   | 655,681    | エネルギー                  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN      |   | 310     | 413   | 5,412   | 702,425    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| LIBERTY BROADBAND-C           |   | 267     | 301   | 3,378   | 438,447    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY BROADBAND-A           |   | 45      | 72    | 773     | 100,348    | メディア・娯楽                |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE |   | 195     | 254   | 2,677   | 347,499    | メディア・娯楽                |
| OWENS CORNING                 |   | 177     | 214   | 1,892   | 245,640    | 資本財                    |

| 銘柄                           | 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        |                        |
| PALO ALTO NETWORKS INC       |   | 159     | 227   | 10,607  | 1,376,523 | ソフトウェア・サービス            |
| SYNCHRONY FINANCIAL          |   | 858     | 1,259 | 4,449   | 577,424   | 各種金融                   |
| QORVO INC                    |   | 186     | 249   | 2,518   | 326,847   | 半導体・半導体製造装置            |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    |   | 209     | —     | —       | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      |   | 311     | 481   | 7,593   | 985,467   | 保険                     |
| ARAMARK                      |   | 411     | 501   | 1,642   | 213,169   | 消費者サービス                |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     |   | 679     | 1,116 | 4,244   | 550,837   | 銀行                     |
| LEAR CORP                    |   | 96      | 134   | 1,666   | 216,296   | 自動車・自動車部品              |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  |   | 191     | 274   | 3,307   | 429,224   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   |   | 345     | —     | —       | —         | 素材                     |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL |   | 62      | 82    | 889     | 115,395   | ソフトウェア・サービス            |
| WESTROCK CO                  |   | 456     | 610   | 3,067   | 398,052   | 素材                     |
| KRAFT HEINZ CO/THE           |   | 1,099   | 1,544 | 6,718   | 871,801   | 食品・飲料・タバコ              |
| PAYPAL HOLDINGS INC          |   | 1,835   | 2,569 | 19,318  | 2,506,918 | ソフトウェア・サービス            |
| EPAM SYSTEMS INC             |   | 95      | 135   | 4,013   | 520,817   | ソフトウェア・サービス            |
| PAYCOM SOFTWARE INC          |   | 81      | 119   | 3,181   | 412,924   | ソフトウェア・サービス            |
| ZILLOW GROUP INC - C         |   | 241     | 397   | 1,409   | 182,864   | 不動産                    |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     |   | 360     | 492   | 4,317   | 560,278   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   |   | 2,054   | 2,892 | 4,506   | 584,814   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| AMERCO                       |   | 14      | 23    | 1,190   | 154,523   | 運輸                     |
| CDW CORP/DE                  |   | 239     | 320   | 5,273   | 684,352   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SOLAREGE TECHNOLOGIES INC    |   | 82      | 115   | 2,510   | 325,793   | 半導体・半導体製造装置            |
| ARISTA NETWORKS INC          |   | 90      | 533   | 5,485   | 711,881   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| COGNEX CORP                  |   | 280     | 406   | 1,897   | 246,190   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TRANSUNION                   |   | 311     | 454   | 3,693   | 479,319   | 商業・専門サービス              |
| GODADDY INC - CLASS A        |   | 266     | 394   | 2,738   | 355,367   | ソフトウェア・サービス            |
| ZENDESK INC                  |   | 188     | 272   | 2,696   | 349,935   | ソフトウェア・サービス            |
| WAYFAIR INC- CLASS A         |   | 111     | 162   | 855     | 111,071   | 小売                     |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C |   | 265     | 411   | 1,609   | 208,835   | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A |   | 148     | 135   | 529     | 68,747    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C |   | 338     | 459   | 2,687   | 348,743   | メディア・娯楽                |
| VAIL RESORTS INC             |   | 63      | 93    | 2,159   | 280,199   | 消費者サービス                |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       |   | 37      | 52    | 2,483   | 322,283   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOMINO'S PIZZA INC           |   | 61      | 88    | 2,874   | 373,062   | 消費者サービス                |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A |   | 230     | 288   | 12,940  | 1,679,259 | メディア・娯楽                |
| IDEXX LABORATORIES INC       |   | 141     | 198   | 6,637   | 861,361   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SMITH (A.O.) CORP            |   | 227     | 336   | 1,929   | 250,387   | 資本財                    |
| UGI CORP                     |   | 350     | 516   | 1,965   | 255,047   | 公益事業                   |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE |   | 328     | 506   | 2,472   | 320,899   | 食品・飲料・タバコ              |
| FORTIVE CORP                 |   | 514     | 802   | 4,618   | 599,289   | 資本財                    |
| IHS MARKIT LTD               |   | 635     | —     | —       | —         | 商業・専門サービス              |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   |   | 397     | 508   | 3,018   | 391,711   | ソフトウェア・サービス            |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       |   | 132     | 199   | 1,439   | 186,786   | ソフトウェア・サービス            |
| COUPA SOFTWARE INC           |   | 110     | 168   | 1,088   | 141,276   | ソフトウェア・サービス            |
| HOWMET AEROSPACE INC         |   | 624     | 908   | 3,046   | 395,310   | 資本財                    |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     |   | 232     | —     | —       | —         | 食品・飲料・タバコ              |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA |   | 103     | —     | —       | —         | 保険                     |
| TELEFLEX INC                 |   | 74      | 104   | 2,793   | 362,510   | ヘルスケア機器・サービス           |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    |   | 227     | 322   | 5,159   | 669,594   | ヘルスケア機器・サービス           |
| TWILIO INC - A               |   | 232     | 405   | 3,751   | 486,793   | ソフトウェア・サービス            |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      |   | 175     | 256   | 2,786   | 361,557   | 各種金融                   |
| SNAP INC - A                 |   | 1,530   | 2,428 | 5,304   | 688,333   | メディア・娯楽                |

| 銘柄                           | 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        |                        |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   |   | 213     | —     | —       | —         | 保険                     |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC |   | 122     | 172   | 2,459   | 319,218   | 保険                     |
| ROLLINS INC                  |   | 362     | 554   | 1,841   | 238,963   | 商業・専門サービス              |
| XPO LOGISTICS INC            |   | 144     | —     | —       | —         | 運輸                     |
| FAIR ISAAC CORP              |   | 46      | 60    | 2,126   | 275,917   | ソフトウェア・サービス            |
| BAKER HUGHES CO              |   | 1,102   | 1,915 | 6,222   | 807,466   | エネルギー                  |
| OKTA INC                     |   | 194     | 355   | 2,998   | 389,148   | ソフトウェア・サービス            |
| DUPONT DE NEMOURS INC        |   | 899     | 1,216 | 7,707   | 1,000,196 | 素材                     |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  |   | 217     | 341   | 1,648   | 213,909   | 運輸                     |
| BLACK KNIGHT INC             |   | 258     | 343   | 2,383   | 309,305   | ソフトウェア・サービス            |
| SEA LTD-ADR                  |   | —       | 724   | 4,139   | 537,205   | メディア・娯楽                |
| BLOCK INC                    |   | 633     | 1,176 | 8,379   | 1,087,458 | ソフトウェア・サービス            |
| VISTRA CORP                  |   | 717     | 1,033 | 2,510   | 325,748   | 公益事業                   |
| INGERSOLL-RAND INC           |   | 614     | 961   | 4,102   | 532,412   | 資本財                    |
| NOVOCURE LTD                 |   | 142     | 211   | 1,227   | 159,242   | ヘルスケア機器・サービス           |
| HUBSPOT INC                  |   | 74      | 107   | 3,337   | 433,102   | ソフトウェア・サービス            |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       |   | 66      | 97    | 3,330   | 432,164   | ソフトウェア・サービス            |
| PTC INC                      |   | 181     | 261   | 2,693   | 349,570   | ソフトウェア・サービス            |
| ZSCALER INC                  |   | 119     | 188   | 2,574   | 334,054   | ソフトウェア・サービス            |
| BROADCOM INC                 |   | 667     | 945   | 53,628  | 6,959,330 | 半導体・半導体製造装置            |
| EVERGY INC                   |   | 392     | 515   | 3,455   | 448,364   | 公益事業                   |
| ALTICE USA INC- A            |   | 427     | —     | —       | —         | メディア・娯楽                |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  |   | 67      | 1,001 | 4,339   | 563,092   | ソフトウェア・サービス            |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  |   | 41      | 58    | 952     | 123,623   | 保険                     |
| DOCUSIGN INC                 |   | 292     | 469   | 3,173   | 411,778   | ソフトウェア・サービス            |
| TELADOC HEALTH INC           |   | 186     | 306   | 879     | 114,196   | ヘルスケア機器・サービス           |
| LINDE PLC                    |   | 866     | 1,177 | 35,371  | 4,590,104 | 素材                     |
| WIX.COM LTD                  |   | 89      | 117   | 686     | 89,123    | ソフトウェア・サービス            |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       |   | 647     | 859   | 2,338   | 303,524   | 各種金融                   |
| BURLINGTON STORES INC        |   | 108     | 147   | 2,561   | 332,358   | 小売                     |
| KKR & CO INC                 |   | 841     | 1,216 | 6,101   | 791,759   | 各種金融                   |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     |   | 669     | 968   | 2,015   | 261,570   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CIGNA CORP                   |   | 595     | 762   | 19,837  | 2,574,297 | ヘルスケア機器・サービス           |
| DELL TECHNOLOGIES -C         |   | 398     | 649   | 2,882   | 374,081   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    |   | —       | 496   | 2,398   | 311,279   | 消費者サービス                |
| MONGODB INC                  |   | 84      | 136   | 3,295   | 427,634   | ソフトウェア・サービス            |
| FOX CORP - CLASS A           |   | 536     | 710   | 2,361   | 306,404   | メディア・娯楽                |
| FOX CORP - CLASS B           |   | 273     | 357   | 1,093   | 141,958   | メディア・娯楽                |
| DOW INC                      |   | 1,234   | 1,704 | 11,382  | 1,477,157 | 素材                     |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  |   | 321     | 490   | 4,156   | 539,396   | ソフトウェア・サービス            |
| AVALARA INC                  |   | 142     | 180   | 1,288   | 167,165   | ソフトウェア・サービス            |
| DROPBOX INC-CLASS A          |   | 533     | 648   | 1,283   | 166,572   | ソフトウェア・サービス            |
| STERIS PLC                   |   | 138     | 232   | 4,951   | 642,514   | ヘルスケア機器・サービス           |
| UBER TECHNOLOGIES INC        |   | 1,613   | 3,401 | 7,676   | 996,212   | 運輸                     |
| CORTEVA INC                  |   | 1,213   | 1,694 | 9,084   | 1,178,916 | 素材                     |
| AMCOR PLC                    |   | 2,577   | 3,406 | 4,261   | 553,044   | 素材                     |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A |   | 294     | 453   | 6,224   | 807,717   | ソフトウェア・サービス            |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A |   | 738     | —     | —       | —         | ソフトウェア・サービス            |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A |   | 140     | 252   | 1,593   | 206,791   | 各種金融                   |
| ROKU INC                     |   | 182     | 272   | 2,141   | 277,912   | メディア・娯楽                |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS |   | 216     | 289   | 2,314   | 300,356   | 商業・専門サービス              |
| DATADOG INC - CLASS A        |   | 284     | 498   | 4,881   | 633,429   | ソフトウェア・サービス            |

| 銘柄                           | 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      |                        |        |   |
| LYFT INC-A                   |   | —       |   | 566   |   | 1,004   |           | 130,327 | 運輸                     |        |   |
| PINTEREST INC- CLASS A       |   | 851     |   | 1,279 |   | 2,417   |           | 313,744 | メディア・娯楽                |        |   |
| CABLE ONE INC                |   | 7       |   | 14    |   | 1,514   |           | 196,584 | メディア・娯楽                |        |   |
| CARVANA CO                   |   | 102     |   | 234   |   | 703     |           | 91,293  | 小売                     |        |   |
| CHEWY INC - CLASS A          |   | 127     |   | 209   |   | 495     |           | 64,280  | 小売                     |        |   |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A    |   | 390     |   | 641   |   | 791     |           | 102,733 | 耐久消費財・アパレル             |        |   |
| ETSY INC                     |   | 214     |   | 296   |   | 2,306   |           | 299,276 | 小売                     |        |   |
| AVANTOR INC                  |   | 865     |   | 1,250 |   | 3,730   |           | 484,065 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| MODERNA INC                  |   | 460     |   | 795   |   | 9,820   | 1,274,449 |         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A     |   | 107     |   | 164   |   | 651     |           | 84,554  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| CLARIVATE PLC                |   | —       |   | 927   |   | 1,265   |           | 164,240 | 商業・専門サービス              |        |   |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     |   | 219     |   | 324   |   | 1,631   |           | 211,715 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| DYNATRACE INC                |   | 288     |   | 387   |   | 1,167   |           | 151,559 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     |   | 319     |   | 600   |   | 3,290   |           | 427,010 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A      |   | 121     |   | 171   |   | 1,056   |           | 137,045 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| RPM INTERNATIONAL INC        |   | 205     |   | 314   |   | 2,630   |           | 341,315 | 素材                     |        |   |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN |   | 2,322   |   | 3,087 |   | 2,016   |           | 261,656 | 各種金融                   |        |   |
| AGNC INVESTMENT CORP         |   | 974     |   | 1,191 |   | 1,446   |           | 187,657 | 各種金融                   |        |   |
| BILL.COM HOLDINGS INC        |   | —       |   | 179   |   | 1,748   |           | 226,959 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| PPD INC                      |   | 212     |   | —     |   | —       |           | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| GENERAC HOLDINGS INC         |   | 102     |   | 146   |   | 2,990   |           | 388,026 | 資本財                    |        |   |
| AON PLC-CLASS A              |   | 376     |   | 506   |   | 13,923  | 1,806,863 |         | 保険                     |        |   |
| OTIS WORLDWIDE CORP          |   | 663     |   | 910   |   | 6,634   |           | 860,975 | 資本財                    |        |   |
| CARRIER GLOBAL CORP          |   | 1,344   |   | 1,903 |   | 7,155   |           | 928,605 | 資本財                    |        |   |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC |   | 285     |   | —     |   | —       |           | —       | 各種金融                   |        |   |
| CARLYLE GROUP INC/THE        |   | 244     |   | 373   |   | 1,325   |           | 171,946 | 各種金融                   |        |   |
| CATALENT INC                 |   | 265     |   | 404   |   | 3,732   |           | 484,415 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| MATCH GROUP INC              |   | 407     |   | 608   |   | 4,245   |           | 550,944 | メディア・娯楽                |        |   |
| IAC/INTERACTIVECORP          |   | 129     |   | 176   |   | 1,368   |           | 177,624 | メディア・娯楽                |        |   |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC    |   | —       |   | 613   |   | 2,468   |           | 320,340 | メディア・娯楽                |        |   |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        |   | 40      |   | 493   |   | 6,558   |           | 851,035 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| SUNRUN INC                   |   | 184     |   | 364   |   | 660     |           | 85,771  | 資本財                    |        |   |
| ASANA INC - CL A             |   | —       |   | 146   |   | 273     |           | 35,505  | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| FIVERR INTERNATIONAL LTD     |   | —       |   | 64    |   | 194     |           | 25,239  | 小売                     |        |   |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     |   | 280     |   | 746   |   | 2,861   |           | 371,310 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| UNITY SOFTWARE INC           |   | —       |   | 119   |   | 361     |           | 46,865  | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  |   | —       |   | 3,747 |   | 2,514   |           | 326,331 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| VIATRIS INC                  |   | 2,012   |   | 2,698 |   | 2,804   |           | 363,890 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| DRAFTKINGS INC - CL A        |   | 276     |   | —     |   | —       |           | —       | 消費者サービス                |        |   |
| ENPHASE ENERGY INC           |   | 197     |   | 299   |   | 4,125   |           | 535,335 | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| DOORDASH INC - A             |   | —       |   | 233   |   | 1,391   |           | 180,601 | 小売                     |        |   |
| KORNIT DIGITAL LTD           |   | —       |   | 101   |   | 380     |           | 49,320  | 資本財                    |        |   |
| AIRBNB INC-CLASS A           |   | 84      |   | 686   |   | 7,977   | 1,035,289 |         | 消費者サービス                |        |   |
| AFFIRM HOLDINGS INC          |   | —       |   | 361   |   | 529     |           | 68,702  | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  |   | —       |   | 401   |   | 1,111   |           | 144,248 | ソフトウェア・サービス            |        |   |
| NOVAVAX INC                  |   | —       |   | 150   |   | 647     |           | 84,019  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |   |
| UPSTART HOLDINGS INC         |   | —       |   | 89    |   | 250     |           | 32,480  | 各種金融                   |        |   |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       |   | 1,317   |   | 1,900 |   | 9,982   | 1,295,476 |         | 半導体・半導体製造装置            |        |   |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  |   | —       |   | 447   |   | 3,455   |           | 448,390 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |        |   |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        |   | —       |   | 120   |   | 352     |           | 45,720  | 各種金融                   |        |   |
| INMODE LTD                   |   | —       |   | 109   |   | 228     |           | 29,661  | ヘルスケア機器・サービス           |        |   |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A  |   | —       |   | 1,088 |   | 1,128   |           | 146,478 | 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        |                        |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      |  | —         | 367     | 756     | 98,108    | 自動車・自動車部品              |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A |  | —         | 82      | 440     | 57,164    | 各種金融                   |
| LUCID GROUP INC              |  | —         | 882     | 1,222   | 158,637   | 自動車・自動車部品              |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A    |  | —         | 397     | 323     | 41,987    | 各種金融                   |
| SOFI TECHNOLOGIES INC        |  | —         | 1,130   | 620     | 80,505    | 各種金融                   |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     |  | —         | 2,373   | 595     | 77,302    | 運輸                     |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC |  | —         | 855     | 4,362   | 566,145   | 各種金融                   |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   |  | —         | 26      | 1,648   | 213,953   | 銀行                     |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       |  | —         | 400     | 1,827   | 237,167   | 銀行                     |
| CONSTELLATION ENERGY         |  | —         | 762     | 4,375   | 567,867   | 公益事業                   |
| WARNER BROS DISCOVERY INC    |  | —         | 5,159   | 8,574   | 1,112,761 | メディア・娯楽                |
| DRAFTKINGS INC-CL A          |  | —         | 749     | 769     | 99,826    | 消費者サービス                |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   |  | 2,004     | 2,711   | 1,274   | 165,349   | 不動産                    |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   |  | 345       | 516     | 2,732   | 354,560   | 資本財                    |
| 小 計                          |  | 株 数 ・ 金 額 | 519,333 | 737,003 | 7,833,428 | 1,016,543,970          |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |  | 593       | 607     | —       | < 69.3% > |                        |
| (カナダ)                        |  |           |         | 千カナダドル  |           |                        |
| ROYAL BANK OF CANADA         |  | 2,338     | 3,270   | 41,329  | 4,130,059 | 銀行                     |
| IMPERIAL OIL LTD             |  | 480       | 570     | 3,547   | 354,519   | エネルギー                  |
| THOMSON REUTERS CORP         |  | 281       | 377     | 4,541   | 453,786   | 商業・専門サービス              |
| TC ENERGY CORP               |  | 1,572     | 2,256   | 15,753  | 1,574,262 | エネルギー                  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  |  | 589       | 792     | 5,106   | 510,324   | 電気通信サービス               |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       |  | 943       | 1,309   | 8,210   | 820,430   | 保険                     |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     |  | 725       | 1,072   | 5,163   | 516,020   | 素材                     |
| BARRICK GOLD CORP            |  | 2,981     | 4,133   | 11,398  | 1,139,083 | 素材                     |
| BCE INC                      |  | 247       | 154     | 1,050   | 104,969   | 電気通信サービス               |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC    |  | 362       | 584     | 459     | 45,928    | 資本財                    |
| BANK OF MONTREAL             |  | 1,061     | 1,481   | 19,463  | 1,944,967 | 銀行                     |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A |  | 2,119     | 3,243   | 19,746  | 1,973,260 | 各種金融                   |
| BANK OF NOVA SCOTIA          |  | 2,004     | 2,785   | 22,441  | 2,242,582 | 銀行                     |
| BAUSCH HEALTH COS INC        |  | 513       | 631     | 831     | 83,044    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CAE INC                      |  | 509       | 749     | 2,074   | 207,327   | 資本財                    |
| CAMECO CORP                  |  | 665       | 944     | 2,550   | 254,890   | エネルギー                  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  |  | 720       | 1,004   | 13,688  | 1,367,895 | 銀行                     |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   |  | 1,982     | 2,696   | 20,500  | 2,048,603 | エネルギー                  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     |  | 1,172     | 1,628   | 23,540  | 2,352,440 | 運輸                     |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   |  | 89        | 129     | 2,119   | 211,785   | 小売                     |
| ENBRIDGE INC                 |  | 3,347     | 4,632   | 25,966  | 2,594,881 | エネルギー                  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  |  | 41        | 55      | 3,670   | 366,835   | 保険                     |
| CGI INC                      |  | 380       | 494     | 4,998   | 499,479   | ソフトウェア・サービス            |
| IGM FINANCIAL INC            |  | 188       | 207     | 743     | 74,323    | 各種金融                   |
| LOBLAW COMPANIES LTD         |  | 277       | 370     | 4,117   | 411,484   | 食品・生活必需品小売り            |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      |  | 3,146     | 4,446   | 10,826  | 1,081,843 | 保険                     |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      |  | 461       | 679     | 4,979   | 497,562   | 自動車・自動車部品              |
| NATIONAL BANK OF CANADA      |  | 551       | 766     | 6,809   | 680,497   | 銀行                     |
| ONEX CORPORATION             |  | 119       | 163     | 1,165   | 116,495   | 各種金融                   |
| POWER CORP OF CANADA         |  | 958       | 1,256   | 4,433   | 443,057   | 保険                     |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    |  | 775       | 1,029   | 3,501   | 349,923   | メディア・娯楽                |
| SUNCOR ENERGY INC            |  | 2,581     | 3,391   | 15,683  | 1,567,239 | エネルギー                  |
| WESTON (GEORGE) LTD          |  | 125       | 185     | 2,755   | 275,361   | 食品・生活必需品小売り            |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD |  | 225       | 2,139   | 19,094  | 1,908,148 | 運輸                     |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       |  | 399       | 1,079   | 7,442   | 743,725   | 素材                     |

| 銘柄                           | 株数    | 期首(前期末) | 当期     |           | 業種等                    |
|------------------------------|-------|---------|--------|-----------|------------------------|
|                              |       | 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        |                        |
| KINROSS GOLD CORP            | 1,919 | 2,843   | 1,592  | 159,096   | 素材                     |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 445   | 684     | 2,260  | 225,903   | 保険                     |
| TMX GROUP LTD                | 94    | 125     | 1,656  | 165,559   | 各種金融                   |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 337   | 428     | 1,636  | 163,552   | 耐久消費財・アパレル             |
| SAPUTO INC                   | 387   | 615     | 1,579  | 157,821   | 食品・飲料・タバコ              |
| BLACKBERRY LTD               | 866   | 1,216   | 772    | 77,161    | ソフトウェア・サービス            |
| TELUS CORP                   | 501   | 1,151   | 3,577  | 357,480   | 電気通信サービス               |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 959   | 1,364   | 4,509  | 450,622   | 素材                     |
| YAMANA GOLD INC              | 1,646 | —       | —      | —         | 素材                     |
| FORTIS INC                   | 761   | 1,089   | 6,882  | 687,766   | 公益事業                   |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  | 1,392 | —       | —      | —         | 食品・生活必需品小売り            |
| LUNDIN MINING CORP           | 1,105 | 1,542   | 1,555  | 155,478   | 素材                     |
| PAN AMERICAN SILVER CORP     | 358   | 501     | 1,428  | 142,785   | 素材                     |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 2,977 | 4,182   | 38,754 | 3,872,746 | 銀行                     |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 319   | 431     | 7,851  | 784,560   | 素材                     |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 720   | 1,016   | 5,482  | 547,849   | 素材                     |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 302   | 417     | 1,714  | 171,350   | 食品・生活必需品小売り            |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 232   | 346     | 1,351  | 135,087   | 公益事業                   |
| METRO INC/CN                 | 401   | 591     | 4,033  | 403,075   | 食品・生活必需品小売り            |
| OPEN TEXT CORP               | 449   | 661     | 3,087  | 308,536   | ソフトウェア・サービス            |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 244   | 405     | 7,084  | 707,970   | 保険                     |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS     | 168   | 270     | 2,046  | 204,489   | 商業・専門サービス              |
| CENOVUS ENERGY INC           | 2,039 | 2,942   | 7,390  | 738,513   | エネルギー                  |
| TOURMALINE OIL CORP          | —     | 744     | 5,141  | 513,818   | エネルギー                  |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 878   | 1,224   | 5,969  | 596,560   | エネルギー                  |
| DOLLARAMA INC                | 464   | 669     | 4,557  | 455,403   | 小売                     |
| KEYERA CORP                  | 319   | 565     | 1,837  | 183,609   | エネルギー                  |
| ALTAGAS LTD                  | 413   | 552     | 1,562  | 156,106   | 公益事業                   |
| ATCO LTD -CLASS I            | 170   | —       | —      | —         | 公益事業                   |
| INTER PIPELINE LTD           | 729   | —       | —      | —         | エネルギー                  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 34    | 47      | 9,093  | 908,691   | ソフトウェア・サービス            |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 478   | 643     | 4,175  | 417,272   | 消費者サービス                |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 132   | 230     | 2,552  | 255,075   | 素材                     |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 238   | 351     | 1,899  | 189,863   | 素材                     |
| HYDRO ONE LTD                | 555   | 691     | 2,392  | 239,125   | 公益事業                   |
| EMERA INC                    | 396   | 605     | 3,791  | 378,888   | 公益事業                   |
| IVANHOE MINES LTD-CL A       | —     | 1,429   | 1,407  | 140,657   | 素材                     |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 182   | 264     | 10,940 | 1,093,276 | ソフトウェア・サービス            |
| NUTRIEN LTD                  | 928   | 1,310   | 16,535 | 1,652,413 | 素材                     |
| WSP GLOBAL INC               | 202   | 261     | 3,535  | 353,303   | 資本財                    |
| CANOPY GROWTH CORP           | 365   | 365     | 235    | 23,489    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 159   | 265     | 1,738  | 173,744   | 保険                     |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD       | 433   | —       | —      | —         | 素材                     |
| QUEBECOR INC -CL B           | 259   | 393     | 1,104  | 110,394   | メディア・娯楽                |
| B2GOLD CORP                  | 1,686 | —       | —      | —         | 素材                     |
| AIR CANADA                   | 345   | 345     | 725    | 72,502    | 運輸                     |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 952   | 1,618   | 2,829  | 282,790   | 公益事業                   |
| PARKLAND CORP                | 257   | 373     | 1,247  | 124,643   | エネルギー                  |
| SSR MINING INC               | 402   | —       | —      | —         | 素材                     |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 208   | 294     | 1,330  | 132,932   | 公益事業                   |
| FIRSTSERVICE CORP            | 61    | 105     | 1,594  | 159,341   | 不動産                    |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 291   | 385     | 1,362  | 136,156   | 商業・専門サービス              |

| 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                 |       |
| (カナダ)                                 |                  | 百株     | 百株      | 千カナダドル  | 千円         |                        |       |
| NORTHLAND POWER INC                   |                  | 328    | 519     | 1,983   | 198,171    | 公益事業                   |       |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD               |                  | 143    | 181     | 1,957   | 195,614    | 資本財                    |       |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC               |                  | —      | 232     | 476     | 47,573     | ソフトウェア・サービス            |       |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG            |                  | —      | 178     | 955     | 95,465     | ソフトウェア・サービス            |       |
| TFI INTERNATIONAL INC                 |                  | —      | 185     | 1,860   | 185,942    | 運輸                     |       |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC          |                  | —      | 1,930   | 10,599  | 1,059,214  | 食品・生活必需品小売り            |       |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 65,555 | 90,472  | 551,350 | 55,096,494 |                        |       |
| (ユーロ…ドイツ)                             |                  |        |         | 千ユーロ    |            |                        |       |
| COMMERZBANK AG                        |                  | 1,614  | 2,592   | 1,625   | 221,973    | 銀行                     |       |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED           |                  | 3,332  | 4,709   | 4,386   | 599,114    | 各種金融                   |       |
| SIEMENS AG-REG                        |                  | 1,260  | 1,758   | 20,543  | 2,805,877  | 資本財                    |       |
| RWE AG                                |                  | 1,076  | 1,470   | 5,940   | 811,319    | 公益事業                   |       |
| BASF SE                               |                  | 1,514  | 2,121   | 10,524  | 1,437,392  | 素材                     |       |
| VOLKSWAGEN AG                         |                  | 59     | 70      | 1,386   | 189,307    | 自動車・自動車部品              |       |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG                |                  | 1,414  | 1,972   | 12,599  | 1,720,806  | 自動車・自動車部品              |       |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF          |                  | 295    | 401     | 2,540   | 346,961    | 家庭用品・パーソナル用品           |       |
| E.ON SE                               |                  | 3,740  | 5,096   | 5,213   | 712,053    | 公益事業                   |       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG           |                  | 537    | 778     | 6,402   | 874,391    | 自動車・自動車部品              |       |
| BAYER AG-REG                          |                  | 1,620  | 2,259   | 13,111  | 1,790,772  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| ALLIANZ SE-REG                        |                  | 678    | 937     | 19,237  | 2,627,461  | 保険                     |       |
| CONTINENTAL AG                        |                  | 174    | 268     | 1,717   | 234,553    | 自動車・自動車部品              |       |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG              |                  | 2,155  | 3,041   | 8,139   | 1,111,660  | 半導体・半導体製造装置            |       |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF            |                  | 246    | 348     | 2,655   | 362,620    | 自動車・自動車部品              |       |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                |                  | 499    | 1,203   | 831     | 113,611    | 運輸                     |       |
| DEUTSCHE POST AG-REG                  |                  | 1,635  | 2,303   | 8,710   | 1,189,627  | 運輸                     |       |
| SAP SE                                |                  | 1,719  | 2,405   | 22,390  | 3,058,158  | ソフトウェア・サービス            |       |
| DEUTSCHE BOERSE AG                    |                  | 306    | 445     | 7,219   | 986,098    | 各種金融                   |       |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & ADIDAS AG |                  | 366    | 472     | 2,769   | 378,313    | ヘルスケア機器・サービス           |       |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG               |                  | 313    | 445     | 8,093   | 1,105,385  | 耐久消費財・アパレル             |       |
| MUNCHENER RUECKVER AG-REG             |                  | 5,491  | 7,428   | 13,007  | 1,776,573  | 電気通信サービス               |       |
| BEIERSDORF AG                         |                  | 234    | 323     | 7,353   | 1,004,400  | 保険                     |       |
| HEIDELBERGCEMENT AG                   |                  | 168    | 226     | 2,114   | 288,747    | 家庭用品・パーソナル用品           |       |
| MERCK KGAA                            |                  | 244    | 327     | 1,789   | 244,448    | 素材                     |       |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                    |                  | 210    | 293     | 4,972   | 679,175    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| PUMA SE                               |                  | 297    | 426     | 6,257   | 854,647    | 自動車・自動車部品              |       |
| LANXESS AG                            |                  | 159    | 256     | 1,686   | 230,294    | 耐久消費財・アパレル             |       |
| FRESENIUS SE & CO KGAA                |                  | 134    | 183     | 658     | 89,933     | 素材                     |       |
| HOCHTIEF AG                           |                  | 683    | 1,009   | 3,438   | 469,667    | ヘルスケア機器・サービス           |       |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                    |                  | 31     | —       | —       | —          | 資本財                    |       |
| GEA GROUP AG                          |                  | 567    | —       | —       | —          | 不動産                    |       |
| SYMRISE AG                            |                  | 255    | 327     | 1,138   | 155,448    | 資本財                    |       |
| HENKEL AG & CO KGAA                   |                  | 213    | 316     | 3,197   | 436,653    | 素材                     |       |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE          |                  | 186    | 225     | 1,411   | 192,825    | 家庭用品・パーソナル用品           |       |
| RATIONAL AG                           |                  | 188    | 188     | 585     | 80,005     | 電気通信サービス               |       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF          |                  | 9      | 12      | 677     | 92,540     | 資本財                    |       |
| HANNOVER RUECK SE                     |                  | 114    | 118     | 887     | 121,230    | 自動車・自動車部品              |       |
| BRENNTAG SE                           |                  | 97     | 133     | 1,926   | 263,149    | 保険                     |       |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR            |                  | 252    | 361     | 2,483   | 339,215    | 資本財                    |       |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF                |                  | 68     | 86      | 976     | 133,353    | ヘルスケア機器・サービス           |       |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI          |                  | 99     | 158     | 472     | 64,555     | 素材                     |       |
|                                       |                  | 1,682  | 1,854   | 540     | 73,870     | 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         |                        |
| LEG IMMOBILIEN SE              |               | 120     | 165     | 1,672   | 228,494    | 不動産                    |
| VONOVIA SE                     |               | 902     | 1,677   | 5,731   | 782,808    | 不動産                    |
| EVONIK INDUSTRIES AG           |               | 332     | 551     | 1,398   | 191,053    | 素材                     |
| ZALANDO SE                     |               | 267     | 483     | 1,554   | 212,272    | 小売                     |
| COVESTRO AG                    |               | 297     | 443     | 1,732   | 236,565    | 素材                     |
| UNIPER SE                      |               | 316     | 242     | 545     | 74,561     | 公益事業                   |
| KION GROUP AG                  |               | 125     | 161     | 743     | 101,546    | 資本財                    |
| MTU AERO ENGINES AG            |               | 92      | 122     | 2,202   | 300,799    | 資本財                    |
| DELIVERY HERO SE               |               | 213     | 351     | 900     | 122,922    | 小売                     |
| SCOUT24 SE                     |               | 178     | 194     | 1,166   | 159,266    | メディア・娯楽                |
| SARTORIUS AG-VORZUG            |               | 56      | 62      | 2,077   | 283,679    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG        |               | 466     | 680     | 3,512   | 479,737    | ヘルスケア機器・サービス           |
| NEMETSCHEK SE                  |               | 84      | 125     | 803     | 109,779    | ソフトウェア・サービス            |
| BECHTLE AG                     |               | 41      | 165     | 672     | 91,817     | ソフトウェア・サービス            |
| KNORR-BREMSE AG                |               | 115     | 187     | 1,241   | 169,631    | 資本財                    |
| HELLOFRESH SE                  |               | 234     | 343     | 1,198   | 163,633    | 食品・生活必需品小売り            |
| TEAMVIEWER AG                  |               | 254     | —       | —       | —          | ソフトウェア・サービス            |
| SIEMENS ENERGY AG              |               | 640     | 852     | 1,382   | 188,871    | 資本財                    |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG       |               | —       | 925     | 2,414   | 329,777    | 資本財                    |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額     | 40,697  | 57,097  | 252,565 | 34,495,419 |                        |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 61      | 59      | —       | < 2.4% >   |                        |
| (ユーロ…イタリア)                     |               |         |         |         |            |                        |
| ASSICURAZIONI GENERALI         |               | 1,803   | 2,564   | 4,554   | 622,082    | 保険                     |
| INTESA SANPAOLO                |               | 27,554  | 39,037  | 7,573   | 1,034,349  | 銀行                     |
| TELECOM ITALIA SPA             |               | 14,225  | 19,437  | 526     | 71,969     | 電気通信サービス               |
| ENI SPA                        |               | 4,086   | 5,871   | 7,996   | 1,092,205  | エネルギー                  |
| UNICREDIT SPA                  |               | 3,616   | 4,889   | 4,582   | 625,856    | 銀行                     |
| ENEL SPA                       |               | 13,386  | 18,792  | 11,237  | 1,534,875  | 公益事業                   |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA    |               | 172     | 230     | 966     | 131,984    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ATLANTIA SPA                   |               | 821     | 1,186   | 2,710   | 370,204    | 運輸                     |
| MEDIOBANCA SPA                 |               | 1,049   | 1,335   | 1,311   | 179,160    | 銀行                     |
| SNAM SPA                       |               | 3,341   | 4,532   | 2,375   | 324,389    | 公益事業                   |
| TELECOM ITALIA-RSP             |               | 8,477   | —       | —       | —          | 電気通信サービス               |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE |               | 2,319   | 3,166   | 2,458   | 335,786    | 公益事業                   |
| PRYSMIAN SPA                   |               | 395     | 571     | 1,624   | 221,865    | 資本財                    |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL   |               | 478     | 716     | 740     | 101,146    | 電気通信サービス               |
| POSTE ITALIANE SPA             |               | 877     | 1,111   | 1,020   | 139,367    | 保険                     |
| FINECOBANK SPA                 |               | 982     | 1,339   | 1,641   | 224,135    | 銀行                     |
| MONCLER SPA                    |               | 307     | 458     | 2,052   | 280,359    | 耐久消費財・アパレル             |
| DIASORIN SPA                   |               | 44      | 61      | 704     | 96,155     | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMPLIFON SPA                   |               | 211     | 281     | 967     | 132,091    | ヘルスケア機器・サービス           |
| NEXI SPA                       |               | 745     | 1,171   | 1,097   | 149,955    | ソフトウェア・サービス            |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額     | 84,895  | 106,755 | 56,142  | 7,667,943  |                        |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 20      | 19      | —       | < 0.5% >   |                        |
| (ユーロ…フランス)                     |               |         |         |         |            |                        |
| MICHELIN (CGDE)                |               | 287     | 392     | 4,617   | 630,671    | 自動車・自動車部品              |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI   |               | 457     | 637     | 36,520  | 4,987,922  | 耐久消費財・アパレル             |
| AXA SA                         |               | 3,202   | 4,483   | 10,293  | 1,405,948  | 保険                     |
| DANONE                         |               | 1,031   | 1,501   | 8,254   | 1,127,376  | 食品・飲料・タバコ              |
| CARREFOUR SA                   |               | 998     | 1,503   | 3,078   | 420,477    | 食品・生活必需品小売り            |
| VIVENDI SE                     |               | 1,337   | 1,841   | 2,024   | 276,474    | メディア・娯楽                |
| SOCIETE GENERALE SA            |               | 1,374   | 1,919   | 4,343   | 593,201    | 銀行                     |

| 銘柄                        | 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        |                        |
| AIR LIQUIDE SA            |   | 781     | 1,088 | 17,237 | 2,354,360 | 素材                     |
| TOTALENERGIES SE          |   | 4,144   | 5,744 | 28,925 | 3,950,654 | エネルギー                  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN |   | 849     | 1,184 | 6,263  | 855,425   | 資本財                    |
| VINCI SA                  |   | 859     | 1,231 | 11,211 | 1,531,239 | 資本財                    |
| SANOFI                    |   | 1,869   | 2,636 | 25,815 | 3,525,937 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT      |   | 868     | 1,552 | 4,137  | 565,167   | 公益事業                   |
| L'OREAL                   |   | 414     | 576   | 18,672 | 2,550,251 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| ACCOR SA                  |   | 307     | 405   | 1,240  | 169,369   | 消費者サービス                |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE     |   | 885     | 1,239 | 15,810 | 2,159,385 | 資本財                    |
| BNP PARIBAS               |   | 1,850   | 2,580 | 13,456 | 1,837,820 | 銀行                     |
| ESSILORLUXOTTICA          |   | 472     | 663   | 9,736  | 1,329,832 | 耐久消費財・アパレル             |
| CAPGEMINI SE              |   | 260     | 371   | 6,679  | 912,230   | ソフトウェア・サービス            |
| VALEO                     |   | 378     | 485   | 864    | 118,007   | 自動車・自動車部品              |
| HERMES INTERNATIONAL      |   | 51      | 72    | 7,653  | 1,045,259 | 耐久消費財・アパレル             |
| SODEXO SA                 |   | 142     | 179   | 1,248  | 170,510   | 消費者サービス                |
| KERING                    |   | 125     | 175   | 8,049  | 1,099,454 | 耐久消費財・アパレル             |
| DASSAULT SYSTEMES SE      |   | 214     | 1,535 | 5,869  | 801,654   | ソフトウェア・サービス            |
| ATOS SE                   |   | 164     | —     | —      | —         | ソフトウェア・サービス            |
| ORANGE                    |   | 3,236   | 4,641 | 5,415  | 739,603   | 電気通信サービス               |
| CNP ASSURANCES            |   | 312     | 312   | 652    | 89,083    | 保険                     |
| SAFRAN SA                 |   | 535     | 788   | 7,555  | 1,031,863 | 資本財                    |
| RENAULT SA                |   | 294     | 455   | 1,045  | 142,861   | 自動車・自動車部品              |
| PUBLICIS GROUPE           |   | 385     | 500   | 2,692  | 367,773   | メディア・娯楽                |
| BOUYGUES SA               |   | 382     | 464   | 1,449  | 197,973   | 資本財                    |
| THALES SA                 |   | 172     | 237   | 2,793  | 381,567   | 資本財                    |
| PERNOD RICARD SA          |   | 350     | 481   | 8,921  | 1,218,517 | 食品・飲料・タバコ              |
| CREDIT AGRICOLE SA        |   | 1,849   | 2,921 | 2,968  | 405,371   | 銀行                     |
| ENGIE                     |   | 3,060   | 4,231 | 4,777  | 652,541   | 公益事業                   |
| ALSTOM                    |   | 425     | 796   | 1,741  | 237,843   | 資本財                    |
| ARKEMA                    |   | 115     | 142   | 1,644  | 224,538   | 素材                     |
| LEGRAND SA                |   | 433     | 608   | 4,854  | 663,040   | 資本財                    |
| SCOR SE                   |   | 271     | —     | —      | —         | 保険                     |
| ADP                       |   | 51      | 75    | 976    | 133,354   | 運輸                     |
| EDF                       |   | 999     | 1,427 | 1,221  | 166,841   | 公益事業                   |
| NATIXIS                   |   | 1,392   | —     | —      | —         | 各種金融                   |
| WENDEL                    |   | 48      | 48    | 436    | 59,631    | 各種金融                   |
| BUREAU VERITAS SA         |   | 453     | 654   | 1,668  | 227,911   | 商業・専門サービス              |
| EURAZEO SE                |   | 71      | 71    | 493    | 67,455    | 各種金融                   |
| SUEZ                      |   | 550     | —     | —      | —         | 公益事業                   |
| EIFFAGE                   |   | 133     | 197   | 1,828  | 249,702   | 資本財                    |
| ILIAD SA                  |   | 27      | —     | —      | —         | 電気通信サービス               |
| ORPEA                     |   | 82      | 113   | 379    | 51,825    | ヘルスケア機器・サービス           |
| BIOMERIEUX                |   | 68      | 97    | 860    | 117,539   | ヘルスケア機器・サービス           |
| GETLINK SE                |   | 681     | 1,082 | 1,854  | 253,313   | 運輸                     |
| EDENRED                   |   | 392     | 576   | 2,535  | 346,351   | ソフトウェア・サービス            |
| REMY COINTREAU            |   | 33      | 47    | 817    | 111,719   | 食品・飲料・タバコ              |
| BOLLORE SE                |   | 1,373   | 1,928 | 906    | 123,875   | メディア・娯楽                |
| DASSAULT AVIATION SA      |   | 4       | 46    | 724    | 99,011    | 資本財                    |
| SEB SA                    |   | 36      | 50    | 540    | 73,798    | 耐久消費財・アパレル             |
| IPSEN                     |   | 67      | 98    | 926    | 126,571   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMUNDI SA                 |   | 105     | 145   | 803    | 109,735   | 各種金融                   |
| FAURECIA                  |   | 199     | 264   | 566    | 77,432    | 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 |
| (ユーロ…フランス)                   |           | 百株      | 百株     | 千ユーロ    | 千円         |                        |        |
| TELEPERFORMANCE              |           | 94      | 135    | 4,208   | 574,850    | 商業・専門サービス              |        |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        |           | 149     | 209    | 871     | 118,998    | メディア・娯楽                |        |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     |           | 49      | 62     | 1,830   | 249,959    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |
| WORLDLINE SA                 |           | 379     | 561    | 1,995   | 272,525    | ソフトウェア・サービス            |        |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   |           | 127     | 175    | 570     | 77,870     | 消費者サービス                |        |
| EUROAPI SASU                 |           | —       | 110    | 151     | 20,722     | 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 | 42,733  | 58,768 | 325,686 | 44,482,214 |                        |        |
|                              | 銘柄数<比率>   | 64      | 60     | —       | <3.0%>     |                        |        |
| (ユーロ…オランダ)                   |           |         |        |         |            |                        |        |
| QIAGEN N.V.                  |           | 358     | 552    | 2,350   | 321,049    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |
| CNH INDUSTRIAL NV            |           | 1,759   | 2,369  | 3,194   | 436,318    | 資本財                    |        |
| STELLANTIS NV                |           | 3,363   | 4,721  | 6,246   | 853,210    | 自動車・自動車部品              |        |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     |           | 920     | 1,149  | 1,140   | 155,775    | 食品・飲料・タバコ              |        |
| FERRARI NV                   |           | 204     | 286    | 5,273   | 720,235    | 自動車・自動車部品              |        |
| EXOR NV                      |           | 167     | 240    | 1,546   | 211,205    | 各種金融                   |        |
| AIRBUS SE                    |           | 973     | 1,355  | 14,573  | 1,990,497  | 資本財                    |        |
| STMICROELECTRONICS NV        |           | 1,072   | 1,601  | 5,503   | 751,687    | 半導体・半導体製造装置            |        |
| EURONEXT NV                  |           | —       | 186    | 1,337   | 182,637    | 各種金融                   |        |
| WOLTERS KLUWER               |           | 451     | 606    | 5,630   | 769,035    | 商業・専門サービス              |        |
| KONINKLIJKE KPN NV           |           | 5,617   | 7,904  | 2,601   | 355,276    | 電気通信サービス               |        |
| AKZO NOBEL N.V.              |           | 312     | 415    | 3,366   | 459,758    | 素材                     |        |
| HEINEKEN NV                  |           | 433     | 594    | 5,557   | 759,025    | 食品・飲料・タバコ              |        |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       |           | 1,498   | 2,146  | 5,049   | 689,647    | ヘルスケア機器・サービス           |        |
| AEGON NV                     |           | 2,833   | 4,201  | 2,029   | 277,211    | 保険                     |        |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N |           | 1,785   | 2,359  | 6,194   | 846,005    | 食品・生活必需品小売り            |        |
| RANDSTAD NV                  |           | 185     | 270    | 1,330   | 181,715    | 商業・専門サービス              |        |
| HEINEKEN HOLDING NV          |           | 210     | 249    | 1,821   | 248,779    | 食品・飲料・タバコ              |        |
| KONINKLIJKE DSM NV           |           | 280     | 409    | 5,836   | 797,092    | 素材                     |        |
| ING GROEP NV                 |           | 6,488   | 8,789  | 7,807   | 1,066,298  | 銀行                     |        |
| ASML HOLDING NV              |           | 702     | 951    | 48,937  | 6,683,910  | 半導体・半導体製造装置            |        |
| VOPAK                        |           | 123     | —      | —       | —          | エネルギー                  |        |
| NN GROUP NV                  |           | 475     | 631    | 2,909   | 397,313    | 保険                     |        |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         |           | 753     | 997    | 1,108   | 151,356    | 銀行                     |        |
| IMCD NV                      |           | —       | 124    | 1,617   | 220,858    | 資本財                    |        |
| ASM INTERNATIONAL NV         |           | 76      | 103    | 2,848   | 389,053    | 半導体・半導体製造装置            |        |
| ADYEN NV                     |           | 30      | 44     | 6,123   | 836,302    | ソフトウェア・サービス            |        |
| JUST EAT TAKEAWAY            |           | 204     | 386    | 688     | 94,075     | 小売                     |        |
| PROSUS NV                    |           | 805     | 2,170  | 9,386   | 1,282,067  | 小売                     |        |
| JDE PEET'S NV                |           | 111     | 243    | 689     | 94,190     | 食品・飲料・タバコ              |        |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV     |           | —       | 1,730  | 3,399   | 464,254    | メディア・娯楽                |        |
| ARGENX SE                    |           | 79      | 103    | 2,879   | 393,213    | 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 | 32,279  | 47,898 | 168,978 | 23,079,060 |                        |        |
|                              | 銘柄数<比率>   | 29      | 31     | —       | <1.6%>     |                        |        |
| (ユーロ…スペイン)                   |           |         |        |         |            |                        |        |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE |           | 365     | 630    | 838     | 114,456    | 資本財                    |        |
| ENDESA SA                    |           | 524     | 680    | 1,343   | 183,489    | 公益事業                   |        |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  |           | 378     | 491    | 1,208   | 165,060    | 資本財                    |        |
| IBERDROLA SA                 |           | 10,062  | 13,400 | 14,572  | 1,990,312  | 公益事業                   |        |
| TELEFONICA SA                |           | 8,525   | 12,354 | 5,753   | 785,824    | 電気通信サービス               |        |
| BANCO SANTANDER SA           |           | 28,504  | 40,011 | 10,775  | 1,471,671  | 銀行                     |        |
| REPSOL SA                    |           | 2,439   | 3,395  | 4,839   | 661,041    | エネルギー                  |        |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA |           | 11,254  | 15,366 | 7,295   | 996,400    | 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                 |
| (ユーロ…スペイン)                   |               | 百株      | 百株      | 千ユーロ   | 千円         |                        |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      |               | 470     | 421     | 1,190  | 162,619    | 公益事業                   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   |               | 1,771   | 2,566   | 5,120  | 699,350    | 小売                     |
| FERROVIAL SA                 |               | 786     | 1,125   | 2,631  | 359,366    | 資本財                    |
| FERROVIAL SA-RTS             |               | —       | 1,125   | 30     | 4,170      | 資本財                    |
| ENAGAS SA                    |               | 423     | 580     | 1,202  | 164,207    | 公益事業                   |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA |               | 715     | 1,062   | 2,015  | 275,285    | 公益事業                   |
| CAIXABANK SA                 |               | 7,152   | 9,891   | 2,922  | 399,210    | 銀行                     |
| GRIFOLS SA                   |               | 493     | 636     | 1,226  | 167,505    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMADEUS IT GROUP SA          |               | 750     | 1,015   | 5,938  | 811,057    | ソフトウェア・サービス            |
| AENA SME SA                  |               | 109     | 176     | 2,320  | 316,928    | 運輸                     |
| CELLNEX TELECOM SA           |               | 732     | 1,159   | 4,715  | 644,001    | 電気通信サービス               |
| EDP RENOVAVEIS SA            |               | —       | 625     | 1,309  | 178,846    | 公益事業                   |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 75,459  | 106,718 | 77,250 | 10,550,807 |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 18      | 20      | —      | <0.7%>     |                        |
| (ユーロ…ベルギー)                   |               |         |         |        |            |                        |
| GALAPAGOS NV                 |               | 73      | —       | —      | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AGEAS                        |               | 283     | 411     | 1,811  | 247,472    | 保険                     |
| UCB SA                       |               | 201     | 291     | 2,983  | 407,462    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  |               | 176     | 263     | 2,231  | 304,722    | 各種金融                   |
| UMICORE                      |               | 315     | 415     | 1,669  | 227,991    | 素材                     |
| COLRUYT SA                   |               | 97      | 97      | 334    | 45,727     | 食品・生活必需品小売り            |
| KBC GROUP NV                 |               | 410     | 587     | 3,239  | 442,437    | 銀行                     |
| SOLVAY SA                    |               | 133     | 160     | 1,486  | 202,988    | 素材                     |
| PROXIMUS                     |               | 268     | 458     | 746    | 101,975    | 電気通信サービス               |
| SOFINA                       |               | 26      | 34      | 966    | 132,018    | 各種金融                   |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   |               | 1,262   | 2,014   | 10,629 | 1,451,793  | 食品・飲料・タバコ              |
| ELIA GROUP SA/NV             |               | 56      | 78      | 1,182  | 161,445    | 公益事業                   |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 3,305   | 4,813   | 27,280 | 3,726,036  |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 12      | 11      | —      | <0.3%>     |                        |
| (ユーロ…オーストリア)                 |               |         |         |        |            |                        |
| ERSTE GROUP BANK AG          |               | 500     | 820     | 2,275  | 310,743    | 銀行                     |
| VERBUND AG                   |               | 112     | 144     | 1,248  | 170,537    | 公益事業                   |
| OMV AG                       |               | 241     | 363     | 1,703  | 232,691    | エネルギー                  |
| VOESTALPINE AG               |               | 169     | 229     | 559    | 76,372     | 素材                     |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA |               | 266     | 380     | 439    | 59,981     | 銀行                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 1,290   | 1,937   | 6,225  | 850,325    |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5       | —      | <0.1%>     |                        |
| (ユーロ…ルクセンブルク)                |               |         |         |        |            |                        |
| AROUNDTOWN SA                |               | 1,705   | 2,178   | 1,021  | 139,472    | 不動産                    |
| TENARIS SA                   |               | 785     | 1,074   | 1,568  | 214,278    | エネルギー                  |
| SES                          |               | 684     | —       | —      | —          | メディア・娯楽                |
| EUROFINS SCIENTIFIC          |               | 233     | 298     | 2,463  | 336,469    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ARCELORMITTAL                |               | 1,192   | 1,407   | 3,785  | 516,993    | 素材                     |
| INPOST SA                    |               | —       | 338     | 190    | 26,064     | 運輸                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 4,601   | 5,296   | 9,029  | 1,233,277  |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5       | —      | <0.1%>     |                        |
| (ユーロ…フィンランド)                 |               |         |         |        |            |                        |
| NOKIA OYJ                    |               | 9,635   | 12,156  | 5,608  | 766,062    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |               | 922     | 1,268   | 2,296  | 313,657    | 素材                     |
| UPM-KYMMENE OYJ              |               | 867     | 1,266   | 4,048  | 552,996    | 素材                     |
| FORTUM OYJ                   |               | 704     | 1,090   | 1,761  | 240,620    | 公益事業                   |
| KESKO OYJ-B SHS              |               | 493     | 591     | 1,431  | 195,470    | 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                 |
| (ユーロ…フィンランド)                 |              | 百株      | 百株      | 千ユーロ     | 千円          |                        |
| KONE OYJ-B                   |              | 554     | 808     | 3,488    | 476,474     | 資本財                    |
| SAMPO OYJ-A SHS              |              | 761     | 1,139   | 5,057    | 690,761     | 保険                     |
| WARTSILA OYJ ABP             |              | 659     | 1,117   | 809      | 110,581     | 資本財                    |
| ELISA OYJ                    |              | 237     | 350     | 1,881    | 257,010     | 電気通信サービス               |
| NESTE OYJ                    |              | 681     | 987     | 3,890    | 531,328     | エネルギー                  |
| ORION OYJ-CLASS B            |              | 180     | 264     | 949      | 129,676     | 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    | 15,698  | 21,041  | 31,224   | 4,264,640   |                        |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 11      | 11      | —        | <0.3%>      |                        |
| (ユーロ…アイルランド)                 |              |         |         |          |             |                        |
| KERRY GROUP PLC-A            |              | 268     | 350     | 3,435    | 469,165     | 食品・飲料・タバコ              |
| KINGSPAN GROUP PLC           |              | 242     | 341     | 2,640    | 360,632     | 資本財                    |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI |              | 274     | 399     | 3,948    | 539,264     | 消費者サービス                |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC      |              | 404     | 604     | 2,276    | 310,863     | 素材                     |
| CRH PLC                      |              | 1,277   | 1,749   | 6,434    | 878,787     | 素材                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 2,468   | 3,445   | 18,734   | 2,558,714   |                        |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 5       | 5       | —        | <0.2%>      |                        |
| (ユーロ…ポルトガル)                  |              |         |         |          |             |                        |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  |              | 4,760   | 6,703   | 3,023    | 412,903     | 公益事業                   |
| JERONIMO MARTINS             |              | 425     | 587     | 1,154    | 157,726     | 食品・生活必需品小売り            |
| GALP ENERGIA SGPS SA         |              | 840     | 1,122   | 1,196    | 163,484     | エネルギー                  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 6,025   | 8,413   | 5,374    | 734,115     |                        |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 3       | 3       | —        | <0.1%>      |                        |
| ユ ー ロ 計                      | 株 数 ・ 金 額    | 309,456 | 422,186 | 978,492  | 133,642,554 |                        |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 233     | 229     | —        | <9.1%>      |                        |
| (イギリス)                       |              |         |         | 千イギリスポンド |             |                        |
| BARCLAYS PLC                 |              | 27,987  | 36,130  | 5,322    | 845,838     | 銀行                     |
| BP PLC                       |              | 32,582  | 42,664  | 17,914   | 2,847,218   | エネルギー                  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     |              | 114,275 | 151,720 | 6,541    | 1,039,630   | 銀行                     |
| ASTRAZENECA PLC              |              | 2,114   | 3,342   | 33,516   | 5,326,764   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SMITHS GROUP PLC             |              | 608     | 914     | 1,340    | 213,079     | 資本財                    |
| NEXT PLC                     |              | 220     | 302     | 1,879    | 298,775     | 小売                     |
| DIAGEO PLC                   |              | 3,765   | 5,011   | 18,841   | 2,994,489   | 食品・飲料・タバコ              |
| BAE SYSTEMS PLC              |              | 5,182   | 6,993   | 5,208    | 827,843     | 資本財                    |
| UNILEVER PLC                 |              | 4,231   | 5,543   | 20,457   | 3,251,271   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| TESCO PLC                    |              | 12,397  | 16,506  | 4,554    | 723,811     | 食品・生活必需品小売り            |
| RELX PLC                     |              | 3,119   | 4,139   | 9,517    | 1,512,552   | 商業・専門サービス              |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  |              | 1,145   | 1,528   | 9,757    | 1,550,810   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HALMA PLC                    |              | 631     | 849     | 1,862    | 295,940     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| PRUDENTIAL PLC               |              | 4,201   | 5,929   | 5,586    | 887,909     | 保険                     |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    |              | 9,618   | 12,984  | 3,151    | 500,842     | 保険                     |
| SAGE GROUP PLC/THE           |              | 1,855   | 2,195   | 1,469    | 233,614     | ソフトウェア・サービス            |
| HSBC HOLDINGS PLC            |              | 32,804  | 43,951  | 21,951   | 3,488,783   | 銀行                     |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC |              | 3,697   | 4,687   | 15,770   | 2,506,373   | 食品・飲料・タバコ              |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   |              | 1,038   | 1,476   | 1,624    | 258,154     | 公益事業                   |
| SCHRODERS PLC                |              | 215     | 290     | 822      | 130,777     | 各種金融                   |
| NATWEST GROUP PLC            |              | 7,634   | 11,812  | 2,427    | 385,810     | 銀行                     |
| BHP GROUP PLC                |              | 3,399   | —       | —        | —           | 素材                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC          |              | 1,534   | 2,079   | 3,523    | 560,064     | 食品・飲料・タバコ              |
| WPP PLC                      |              | 2,004   | 2,502   | 2,403    | 381,993     | メディア・娯楽                |
| BT GROUP PLC                 |              | 13,947  | 19,609  | 3,460    | 549,910     | 電気通信サービス               |
| SSE PLC                      |              | 1,681   | 2,262   | 4,164    | 661,850     | 公益事業                   |
| STANDARD CHARTERED PLC       |              | 4,375   | 5,467   | 3,124    | 496,527     | 銀行                     |

| 銘柄                           | 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        |                        |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     |   | 13,239  | 18,752 | 1,509    | 239,920   | 資本財                    |
| COMPASS GROUP PLC            |   | 2,872   | 3,812  | 6,458    | 1,026,426 | 消費者サービス                |
| KINGFISHER PLC               |   | 3,237   | 4,503  | 1,111    | 176,628   | 小売                     |
| PEARSON PLC                  |   | 1,243   | 1,566  | 1,190    | 189,256   | メディア・娯楽                |
| SEVERN TRENT PLC             |   | 379     | 555    | 1,696    | 269,564   | 公益事業                   |
| RIO TINTO PLC                |   | 1,810   | 2,408  | 12,902   | 2,050,661 | 素材                     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          |   | 8,078   | 10,971 | 19,090   | 3,034,016 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 3I GROUP PLC                 |   | 1,531   | 2,146  | 2,765    | 439,449   | 各種金融                   |
| VODAFONE GROUP PLC           |   | 43,207  | 59,203 | 7,036    | 1,118,377 | 電気通信サービス               |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     |   | 3,561   | —      | —        | —         | 食品・生活必需品小売り            |
| SAINSBURY (J) PLC            |   | 2,645   | 3,513  | 812      | 129,203   | 食品・生活必需品小売り            |
| AVIVA PLC                    |   | 6,357   | 8,022  | 3,298    | 524,183   | 保険                     |
| JOHNSON MATTHEY PLC          |   | 317     | 408    | 962      | 152,893   | 素材                     |
| RENTOKIL INITIAL PLC         |   | 3,071   | 4,170  | 2,118    | 336,717   | 商業・専門サービス              |
| RSA INSURANCE GROUP LTD      |   | 1,542   | —      | —        | —         | 保険                     |
| WHITBREAD PLC                |   | 338     | 412    | 1,075    | 170,870   | 消費者サービス                |
| NATIONAL GRID PLC            |   | 5,676   | 7,884  | 9,454    | 1,502,540 | 公益事業                   |
| BUNZL PLC                    |   | 530     | 710    | 2,063    | 328,013   | 資本財                    |
| ANGLO AMERICAN PLC           |   | 1,981   | 2,780  | 9,446    | 1,501,301 | 素材                     |
| INTERTEK GROUP PLC           |   | 266     | 325    | 1,599    | 254,148   | 商業・専門サービス              |
| BURBERRY GROUP PLC           |   | 663     | 908    | 1,406    | 223,514   | 耐久消費財・アパレル             |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU |   | 272     | 420    | 2,083    | 331,087   | 消費者サービス                |
| PERSIMMON PLC                |   | 531     | 644    | 1,345    | 213,918   | 耐久消費財・アパレル             |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  |   | 509     | 702    | 5,071    | 805,963   | 各種金融                   |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  |   | 208     | 250    | 982      | 156,133   | 耐久消費財・アパレル             |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     |   | 1,578   | 2,200  | 1,054    | 167,614   | 耐久消費財・アパレル             |
| SMITH & NEPHEW PLC           |   | 1,433   | 1,974  | 2,429    | 386,157   | ヘルスケア機器・サービス           |
| TAYLOR WIMPEY PLC            |   | 5,611   | 8,425  | 1,034    | 164,438   | 耐久消費財・アパレル             |
| SHELL PLC                    |   | 6,642   | —      | —        | —         | エネルギー                  |
| SHELL PLC                    |   | 5,946   | —      | —        | —         | エネルギー                  |
| ABRDN PLC                    |   | 3,508   | 4,461  | 824      | 131,095   | 各種金融                   |
| EXPERIAN PLC                 |   | 1,481   | 1,973  | 5,252    | 834,825   | 商業・専門サービス              |
| MONDI PLC                    |   | 758     | 991    | 1,552    | 246,670   | 素材                     |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC |   | 566     | 809    | 1,301    | 206,768   | 食品・飲料・タバコ              |
| ANTOFAGASTA PLC              |   | 621     | 789    | 1,106    | 175,887   | 素材                     |
| ADMIRAL GROUP PLC            |   | 303     | 466    | 1,043    | 165,846   | 保険                     |
| FRESNILLO PLC                |   | 281     | —      | —        | —         | 素材                     |
| ST JAMES'S PLACE PLC         |   | 828     | 1,133  | 1,380    | 219,333   | 各種金融                   |
| GLENCORE PLC                 |   | 16,142  | 21,484 | 10,226   | 1,625,330 | 素材                     |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC |   | 114     | 164    | 1,798    | 285,857   | 資本財                    |
| EVRAZ PLC                    |   | 826     | —      | —        | —         | 素材                     |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      |   | 532     | 826    | 738      | 117,390   | 各種金融                   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      |   | 221     | 307    | 2,090    | 332,204   | 素材                     |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       |   | 7,647   | 9,717  | 1,095    | 174,135   | 資本財                    |
| COCA-COLA HBC AG-DI          |   | 342     | 444    | 709      | 112,785   | 食品・飲料・タバコ              |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  |   | 2,009   | —      | —        | —         | 保険                     |
| AVEVA GROUP PLC              |   | 196     | 266    | 560      | 89,015    | ソフトウェア・サービス            |
| ASHTAD GROUP PLC             |   | 725     | 956    | 3,667    | 582,903   | 資本財                    |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    |   | 255     | 335    | 580      | 92,334    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| OCADO GROUP PLC              |   | 794     | 1,062  | 811      | 129,030   | 食品・生活必需品小売り            |
| AUTO TRADER GROUP PLC        |   | 1,594   | 2,010  | 1,120    | 178,057   | メディア・娯楽                |
| DCC PLC                      |   | 151     | 232    | 1,419    | 225,660   | 資本財                    |

| 銘柄                            |                            | 期首(前期末) | 当 期 末   |          | 業 種 等      |                        |
|-------------------------------|----------------------------|---------|---------|----------|------------|------------------------|
|                               |                            | 株 数     | 株 数     | 評 価 額    |            |                        |
|                               |                            |         |         | 外貨建金額    |            | 邦貨換算金額                 |
| (イギリス)                        |                            | 百株      | 百株      | 千イギリスポンド | 千円         |                        |
| ENTAIN PLC                    |                            | 961     | 1,191   | 1,531    | 243,454    | 消費者サービス                |
| INFORMA PLC                   |                            | 2,340   | 3,092   | 1,667    | 265,093    | メディア・娯楽                |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC    |                            | 944     | 1,651   | 987      | 156,882    | 保険                     |
| FERGUSON PLC                  |                            | 361     | 475     | 4,466    | 709,878    | 資本財                    |
| M&G PLC                       |                            | 4,373   | 5,575   | 1,167    | 185,555    | 各種金融                   |
| JD SPORTS FASHION PLC         |                            | 766     | 4,979   | 592      | 94,102     | 小売                     |
| SHELL PLC                     |                            | —       | 16,646  | 38,562   | 6,128,741  | エネルギー                  |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 471,214 | 620,625 | 392,452  | 62,372,485 |                        |
|                               |                            | 85      | 78      | —        | <4.3%>     |                        |
| (スイス)                         |                            |         |         | 千スイスフラン  |            |                        |
| NESTLE SA-REG                 |                            | 4,743   | 6,474   | 78,840   | 10,292,642 | 食品・飲料・タバコ              |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG  |                            | 862     | 1,200   | 12,918   | 1,686,487  | 耐久消費財・アパレル             |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG    |                            | 3,950   | 6,364   | 4,050    | 528,773    | 各種金融                   |
| HOLCIM LTD                    |                            | 870     | 1,204   | 5,580    | 728,497    | 素材                     |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN |                            | 1,151   | 1,618   | 53,093   | 6,931,338  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GIVAUDAN-REG                  |                            | 15      | 21      | 7,425    | 969,432    | 素材                     |
| SONOVA HOLDING AG-REG         |                            | 89      | 118     | 3,920    | 511,790    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG     |                            | 247     | 345     | 15,369   | 2,006,477  | 保険                     |
| BACHEM HOLDING AG-REG B       |                            | —       | 68      | 480      | 62,738     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG      |                            | 16      | 225     | 2,530    | 330,307    | ヘルスケア機器・サービス           |
| LONZA GROUP AG-REG            |                            | 124     | 172     | 9,123    | 1,191,058  | 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       |                            | 70      | 116     | 543      | 70,916     | 耐久消費財・アパレル             |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT   |                            | 64      | 87      | 1,586    | 207,087    | 資本財                    |
| GEBERIT AG-REG                |                            | 60      | 85      | 4,384    | 572,361    | 資本財                    |
| SWISS RE AG                   |                            | 461     | 690     | 5,572    | 727,482    | 保険                     |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR        |                            | 50      | 63      | 1,550    | 202,404    | 耐久消費財・アパレル             |
| NOVARTIS AG-REG               |                            | 3,657   | 5,037   | 42,671   | 5,570,761  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADECCO GROUP AG-REG           |                            | 274     | 337     | 1,163    | 151,934    | 商業・専門サービス              |
| SWISSCOM AG-REG               |                            | 42      | 60      | 3,494    | 456,212    | 電気通信サービス               |
| ABB LTD-REG                   |                            | 3,038   | 3,784   | 10,749   | 1,403,330  | 資本財                    |
| CLARIANT AG-REG               |                            | 297     | 420     | 729      | 95,267     | 素材                     |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG    |                            | 265     | 401     | 2,344    | 306,026    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ROCHE HOLDING AG-BR           |                            | 59      | 72      | 2,607    | 340,409    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SGS SA-REG                    |                            | 9       | 13      | 3,210    | 419,118    | 商業・専門サービス              |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG      |                            | 42      | 51      | 924      | 120,755    | 資本財                    |
| TEMENOS AG - REG              |                            | 108     | 154     | 1,540    | 201,134    | ソフトウェア・サービス            |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG    |                            | 93      | 124     | 3,066    | 400,314    | 運輸                     |
| BALOISE HOLDING AG - REG      |                            | 84      | 107     | 1,735    | 226,565    | 保険                     |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG     |                            | 50      | 71      | 3,873    | 505,713    | 保険                     |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG   |                            | 0.17    | 0.23    | 2,373    | 309,873    | 食品・飲料・タバコ              |
| JULIUS BAER GROUP LTD         |                            | 388     | 514     | 2,398    | 313,142    | 各種金融                   |
| SIKA AG-REG                   |                            | 229     | 330     | 8,586    | 1,120,933  | 素材                     |
| SWISS PRIME SITE-REG          |                            | 119     | 183     | 1,748    | 228,327    | 不動産                    |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC    |                            | 1       | 2       | 2,462    | 321,508    | 食品・飲料・タバコ              |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG     |                            | 30      | 53      | 5,478    | 715,174    | 各種金融                   |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG        |                            | 4       | 8       | 1,926    | 251,537    | 食品・飲料・タバコ              |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG  |                            | 45      | —       | —        | —          | 銀行                     |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG     |                            | 13      | 17      | 1,435    | 187,350    | 素材                     |
| UBS GROUP AG-REG              |                            | 6,035   | 8,080   | 13,708   | 1,789,655  | 各種金融                   |
| VIFOR PHARMA AG               |                            | 72      | —       | —        | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VAT GROUP AG                  |                            | —       | 59      | 1,616    | 210,998    | 資本財                    |
| ALCON INC                     |                            | 796     | 1,150   | 8,058    | 1,052,096  | 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                 |  |
| (スイス)                        |   | 百株        | 百株     | 千円          |           |                        |  |
| VIFOR PHARMA AG-NEW          |   | —         | 112    | 1,977       | 258,227   | 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 | 28,541 | 40,008      | 336,853   | 43,976,165             |  |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |   | 40        | 41     | —           | <3.0%>    |                        |  |
| (スウェーデン)                     |   |           |        | 千スウェーデンクローネ |           |                        |  |
| ELECTROLUX AB-B              |   | 385       | 546    | 8,359       | 107,751   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ERICSSON LM-B SHS            |   | 4,900     | 6,613  | 50,739      | 654,034   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         |   | 669       | 855    | 32,430      | 418,028   | 資本財                    |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A |   | 2,669     | 3,830  | 40,751      | 525,288   | 銀行                     |  |
| INVESTOR AB-B SHS            |   | 734       | 4,159  | 71,998      | 928,056   | 各種金融                   |  |
| GETINGE AB-B SHS             |   | —         | 498    | 14,468      | 186,493   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |   | 2,668     | 3,332  | 32,265      | 415,899   | 銀行                     |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         |   | 1,084     | 1,504  | 65,730      | 847,266   | 資本財                    |  |
| SKF AB-B SHARES              |   | 610       | 872    | 14,792      | 190,674   | 資本財                    |  |
| ASSA ABLOY AB-B              |   | 1,631     | 2,258  | 52,175      | 672,548   | 資本財                    |  |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    |   | 1,376     | 1,550  | 18,783      | 242,115   | 小売                     |  |
| SANDVIK AB                   |   | 1,884     | 2,578  | 48,462      | 624,677   | 資本財                    |  |
| SWEDBANK AB - A SHARES       |   | 1,557     | 1,987  | 29,526      | 380,593   | 銀行                     |  |
| SECURITAS AB-B SHS           |   | 461       | 638    | 6,690       | 86,234    | 商業・専門サービス              |  |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   |   | 966       | 1,353  | 24,435      | 314,976   | 素材                     |  |
| SKANSKA AB-B SHS             |   | 554       | 805    | 13,505      | 174,084   | 資本財                    |  |
| SWEDISH MATCH AB             |   | 2,556     | 3,707  | 38,376      | 494,679   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TELE2 AB-B SHS               |   | 796       | 1,262  | 16,599      | 213,962   | 電気通信サービス               |  |
| TELIA CO AB                  |   | 4,092     | 6,358  | 25,764      | 332,105   | 電気通信サービス               |  |
| VOLVO AB-A SHS               |   | —         | 603    | 9,971       | 128,528   | 資本財                    |  |
| VOLVO AB-B SHS               |   | 2,310     | 3,110  | 49,211      | 634,337   | 資本財                    |  |
| ALFA LAVAL AB                |   | 563       | 786    | 20,143      | 259,649   | 資本財                    |  |
| LUNDIN ENERGY AB             |   | 316       | 492    | 20,717      | 267,050   | エネルギー                  |  |
| BOLIDEN AB                   |   | 423       | 582    | 21,400      | 275,857   | 素材                     |  |
| BOLIDEN AB-RED SHS           |   | 423       | 582    | 902         | 11,630    | 素材                     |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS           |   | 713       | 1,001  | 9,082       | 117,073   | 資本財                    |  |
| HEXAGON AB-B SHS             |   | 456       | 4,444  | 51,714      | 666,603   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| KINNEVIK AB - B              |   | 380       | 544    | 9,215       | 118,789   | 各種金融                   |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      |   | 257       | 345    | 8,511       | 109,708   | 各種金融                   |  |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS  |   | 152       | 245    | 10,773      | 138,871   | 不動産                    |  |
| ICA GRUPPEN AB               |   | 172       | —      | —           | —         | 食品・生活必需品小売り            |  |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     |   | 499       | 3,100  | 26,412      | 340,460   | 資本財                    |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS           |   | 153       | 151    | 6,857       | 88,395    | 各種金融                   |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          |   | 996       | 1,467  | 38,678      | 498,571   | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      |   | 175       | 332    | 8,324       | 107,301   | 各種金融                   |  |
| EPIROC AB-B                  |   | 656       | 852    | 13,390      | 172,606   | 資本財                    |  |
| EPIROC AB-A                  |   | 1,138     | 1,602  | 28,959      | 373,286   | 資本財                    |  |
| NORDEA BANK ABP              |   | 5,386     | 7,491  | 71,483      | 921,422   | 銀行                     |  |
| EQT AB                       |   | 388       | 686    | 17,648      | 227,488   | 各種金融                   |  |
| EVOLUTION AB                 |   | 260       | 392    | 35,675      | 459,850   | 消費者サービス                |  |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   |   | 262       | 358    | 7,923       | 102,138   | 資本財                    |  |
| SINCH AB                     |   | —         | 1,110  | 4,557       | 58,741    | ソフトウェア・サービス            |  |
| EMBRACER GROUP AB            |   | —         | 1,291  | 8,783       | 113,225   | メディア・娯楽                |  |
| INVESTOR AB-A SHS            |   | —         | 1,222  | 22,771      | 293,530   | 各種金融                   |  |
| LIFCO AB-B SHS               |   | —         | 514    | 9,218       | 118,827   | 資本財                    |  |
| SAGAX AB-B                   |   | —         | 347    | 7,772       | 100,191   | 不動産                    |  |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 45,690 | 78,376      | 1,125,958 | 14,513,607             |  |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |   | 39        | 45     | —           | <1.0%>    |                        |  |

| 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         |                        |
| DNB ASA                      |               | 1,493   | —      | —          | —          | 銀行                     |
| NORSK HYDRO ASA              |               | 2,203   | 3,117  | 21,190     | 282,467    | 素材                     |
| ORKLA ASA                    |               | 1,212   | 1,570  | 11,681     | 155,715    | 食品・飲料・タバコ              |
| EQUINOR ASA                  |               | 1,561   | 2,283  | 75,323     | 1,004,055  | エネルギー                  |
| TELENOR ASA                  |               | 1,136   | 1,496  | 19,208     | 256,043    | 電気通信サービス               |
| YARA INTERNATIONAL ASA       |               | 281     | 400    | 17,868     | 238,193    | 素材                     |
| MOWI ASA                     |               | 712     | 942    | 22,775     | 303,599    | 食品・飲料・タバコ              |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    |               | 350     | 501    | 9,769      | 130,226    | 保険                     |
| SCHIBSTED ASA-CL A           |               | 112     | 182    | 3,299      | 43,980     | メディア・娯楽                |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          |               | 214     | 213    | 3,509      | 46,785     | メディア・娯楽                |
| AKER BP ASA                  |               | —       | 284    | 9,928      | 132,348    | エネルギー                  |
| ADEVINTA ASA                 |               | 415     | 558    | 3,334      | 44,451     | メディア・娯楽                |
| DNB BANK ASA                 |               | —       | 2,183  | 39,079     | 520,924    | 銀行                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 9,693   | 13,735 | 236,968    | 3,158,791  |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 11      | 12     | —          | < 0.2% >   |                        |
| (デンマーク)                      |               |         |        | 千デンマーククローネ |            |                        |
| NOVO NORDISK A/S-B           |               | 2,839   | 3,871  | 289,225    | 5,310,183  | 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       |               | 343     | 487    | 21,106     | 387,524    | 素材                     |
| DANSKE BANK A/S              |               | 1,122   | 1,492  | 15,768     | 289,503    | 銀行                     |
| DEMANT A/S                   |               | 211     | 211    | 6,000      | 110,166    | ヘルスケア機器・サービス           |
| H LUNDBECK A/S               |               | 129     | —      | —          | —          | 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      |               | 1,661   | 2,378  | 36,852     | 676,619    | 資本財                    |
| GN STORE NORD A/S            |               | 207     | 316    | 7,079      | 129,983    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CARLSBERG AS-B               |               | 177     | 223    | 19,375     | 355,742    | 食品・飲料・タバコ              |
| COLOPLAST-B                  |               | 192     | 286    | 24,590     | 451,482    | ヘルスケア機器・サービス           |
| DSV A/S                      |               | 336     | 480    | 50,094     | 919,729    | 運輸                     |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       |               | 10      | 13     | 26,277     | 482,451    | 運輸                     |
| TRYG A/S                     |               | 541     | 802    | 12,377     | 227,253    | 保険                     |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A       |               | 4       | 7      | 13,404     | 246,110    | 運輸                     |
| PANDORA A/S                  |               | 160     | 251    | 13,555     | 248,888    | 耐久消費財・アパレル             |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       |               | 188     | 230    | 12,071     | 221,638    | 素材                     |
| GENMAB A/S                   |               | 106     | 148    | 30,675     | 563,201    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ORSTED A/S                   |               | 315     | 435    | 31,065     | 570,360    | 公益事業                   |
| ROCKWOOL A/S-B SHS           |               | 11      | 16     | 2,984      | 54,796     | 資本財                    |
| AMBU A/S-B                   |               | 258     | 385    | 3,447      | 63,287     | ヘルスケア機器・サービス           |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 8,820   | 12,038 | 615,954    | 11,308,924 |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 19      | 18     | —          | < 0.8% >   |                        |
| (オーストラリア)                    |               |         |        | 千オーストラリアドル |            |                        |
| BHP GROUP LTD                |               | 4,856   | 11,658 | 53,230     | 4,793,948  | 素材                     |
| CSL LTD                      |               | 750     | 1,105  | 30,540     | 2,750,456  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD       |               | 1,591   | 2,176  | 6,643      | 598,306    | エネルギー                  |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    |               | 4,677   | 6,525  | 16,574     | 1,492,694  | 銀行                     |
| RIO TINTO LTD                |               | 617     | 836    | 8,839      | 796,059    | 素材                     |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      |               | 2,391   | 3,535  | 4,373      | 393,876    | 保険                     |
| LENDLEASE GROUP              |               | 1,189   | 1,631  | 1,859      | 167,487    | 不動産                    |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL |               | 2,922   | 3,927  | 39,869     | 3,590,672  | 銀行                     |
| WESTPAC BANKING CORP         |               | 5,988   | 8,454  | 20,501     | 1,846,330  | 銀行                     |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  |               | 5,427   | 7,536  | 23,008     | 2,072,179  | 銀行                     |
| BRAMBLES LTD                 |               | 2,625   | 3,525  | 3,687      | 332,120    | 商業・専門サービス              |
| QANTAS AIRWAYS LTD           |               | 1,577   | 2,406  | 1,277      | 115,087    | 運輸                     |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         |               | 2,120   | 2,777  | 10,484     | 944,257    | 食品・生活必需品小売り            |
| TELSTRA CORP LTD             |               | 6,760   | 9,046  | 3,537      | 318,551    | 電気通信サービス               |

| 銘<br>柄                       | 株<br>数        | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |           | 業<br>種<br>等  |
|------------------------------|---------------|---------|-------------|-----------|--------------|
|                              |               | 株<br>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        |              |
| AMP LTD                      | 6,147         | —       | —           | —         | 各種金融         |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 3,590         | 5,422   | 2,738       | 246,629   | 消費者サービス      |
| COMPUTERSHARE LTD            | 1,041         | 1,257   | 2,993       | 269,572   | ソフトウェア・サービス  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 929           | 1,318   | 4,195       | 377,809   | 消費者サービス      |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 578           | 785     | 14,309      | 1,288,749 | 各種金融         |
| CIMIC GROUP LTD              | 123           | —       | —           | —         | 資本財          |
| ASX LTD                      | 326           | 444     | 3,652       | 328,957   | 各種金融         |
| COCHLEAR LTD                 | 104           | 141     | 3,023       | 272,326   | ヘルスケア機器・サービス |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 777           | 981     | 3,799       | 342,172   | 素材           |
| NEWCREST MINING LTD          | 1,336         | 2,002   | 4,977       | 448,308   | 素材           |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 3,758         | 5,256   | 2,428       | 218,696   | 保険           |
| ORIGIN ENERGY LTD            | 2,786         | 4,357   | 2,989       | 269,228   | 公益事業         |
| ORICA LTD                    | 814           | 814     | 1,275       | 114,896   | 素材           |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 715           | 1,069   | 3,769       | 339,466   | ヘルスケア機器・サービス |
| SANTOS LTD                   | 2,990         | 7,522   | 5,995       | 539,946   | エネルギー        |
| SUNCORP GROUP LTD            | 2,150         | 3,025   | 3,473       | 312,799   | 保険           |
| TRANSURBAN GROUP             | 4,582         | 7,186   | 10,061      | 906,124   | 運輸           |
| WESFARMERS LTD               | 1,879         | 2,570   | 12,680      | 1,141,999 | 小売           |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | 800           | 1,216   | 2,154       | 194,004   | 素材           |
| SYDNEY AIRPORT               | 2,125         | —       | —           | —         | 運輸           |
| AMPOL LTD                    | 427           | 592     | 1,934       | 174,225   | エネルギー        |
| OIL SEARCH LTD               | 3,240         | —       | —           | —         | エネルギー        |
| AGL ENERGY LTD               | 1,003         | —       | —           | —         | 公益事業         |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 2,729         | 3,979   | 7,779       | 700,652   | 素材           |
| AUSNET SERVICES              | 3,608         | —       | —           | —         | 公益事業         |
| CROWN RESORTS LTD            | 681           | 681     | 866         | 78,050    | 消費者サービス      |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 3,162         | 4,381   | 1,748       | 157,452   | 運輸           |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 1,246         | 1,612   | 1,801       | 162,221   | 食品・飲料・タバコ    |
| APA GROUP                    | 1,938         | 2,448   | 2,725       | 245,423   | 公益事業         |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 331           | 398     | 3,067       | 276,248   | ヘルスケア機器・サービス |
| SEEK LTD                     | 526           | 817     | 2,093       | 188,539   | メディア・娯楽      |
| REA GROUP LTD                | 86            | 114     | 1,269       | 114,356   | メディア・娯楽      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         | 4,446         | 5,712   | 1,816       | 163,611   | 保険           |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | —             | 129     | 908         | 81,852    | 消費者サービス      |
| SOUTH32 LTD                  | 7,600         | 11,006  | 4,854       | 437,156   | 素材           |
| EVOLUTION MINING LTD         | 2,710         | 3,768   | 1,345       | 121,159   | 素材           |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 209           | —       | —           | —         | 各種金融         |
| IDP EDUCATION LTD            | —             | 456     | 1,142       | 102,869   | 消費者サービス      |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 1,707         | 2,518   | 2,200       | 198,201   | 素材           |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 139           | 433     | 1,181       | 106,428   | エネルギー        |
| COLES GROUP LTD              | 2,190         | 3,220   | 5,990       | 539,512   | 食品・生活必需品小売り  |
| WISETECH GLOBAL LTD          | 214           | 306     | 1,257       | 113,226   | ソフトウェア・サービス  |
| MINERAL RESOURCES LTD        | —             | 379     | 2,061       | 185,683   | 素材           |
| AFTERPAY LTD                 | 345           | —       | —           | —         | ソフトウェア・サービス  |
| TPG TELECOM LTD              | 479           | —       | —           | —         | 電気通信サービス     |
| XERO LTD                     | 192           | 335     | 2,920       | 262,992   | ソフトウェア・サービス  |
| REECE LTD                    | —             | 536     | 903         | 81,386    | 資本財          |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | —             | 2,846   | 2,203       | 198,426   | 食品・生活必需品小売り  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 120,274 | 157,193     | 361,019   | 32,513,394   |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 57      | 53          | —         | < 2.2% >     |
| (ニュージーランド)                   |               |         | 千ニュージーランドドル |           |              |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 2,972         | 3,841   | 1,836       | 149,965   | 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 |
| (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         |              |   |   |        |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    |               | 2,002     | 2,646   | 1,897   |            | 155,011    | 運輸           |   |   |        |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C |               | 924       | 1,407   | 2,940   |            | 240,217    | ヘルスケア機器・サービス |   |   |        |
| RYMAN HEALTHCARE LTD         |               | 653       | 990     | 864     |            | 70,579     | ヘルスケア機器・サービス |   |   |        |
| MERIDIAN ENERGY LTD          |               | 2,072     | 3,106   | 1,428   |            | 116,720    | 公益事業         |   |   |        |
| MERCURY NZ LTD               |               | 1,230     | 1,230   | 705     |            | 57,601     | 公益事業         |   |   |        |
| A2 MILK CO LTD               |               | 1,153     | —       | —       |            | —          | 食品・飲料・タバコ    |   |   |        |
| 小                            | 計             | 株 数 ・ 金 額 | 11,009  | 13,223  | 9,673      | 790,096    |              |   |   |        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > |           | 7       | 6       | —          | <0.1%>     |              |   |   |        |
| (香港)                         |               |           |         |         | 千香港ドル      |            |              |   |   |        |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     |               | 850       | 850     | 3,706   |            | 61,260     | 不動産          |   |   |        |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    |               | 4,388     | 6,188   | 33,542  |            | 554,459    | 資本財          |   |   |        |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      |               | 2,220     | 3,020   | 27,391  |            | 452,779    | 不動産          |   |   |        |
| MTR CORP                     |               | 2,535     | 3,765   | 16,245  |            | 268,545    | 運輸           |   |   |        |
| HONG KONG & CHINA GAS        |               | 18,308    | 24,313  | 20,423  |            | 337,597    | 公益事業         |   |   |        |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        |               | 2,792     | 3,622   | 10,251  |            | 169,460    | 不動産          |   |   |        |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    |               | 2,345     | 2,910   | 15,786  |            | 260,954    | 公益事業         |   |   |        |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  |               | 1,988     | 2,786   | 90,656  |            | 1,498,550  | 各種金融         |   |   |        |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     |               | 3,400     | 4,940   | 7,034   |            | 116,281    | 不動産          |   |   |        |
| CLP HOLDINGS LTD             |               | 2,575     | 3,860   | 29,297  |            | 484,286    | 公益事業         |   |   |        |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   |               | 2,346     | 3,196   | 10,068  |            | 166,435    | 不動産          |   |   |        |
| BANK OF EAST ASIA LTD        |               | 2,088     | —       | —       |            | —          | 銀行           |   |   |        |
| HANG SENG BANK LTD           |               | 1,265     | 1,791   | 24,948  |            | 412,400    | 銀行           |   |   |        |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY       |               | 441       | —       | —       |            | —          | 半導体・半導体製造装置  |   |   |        |
| SINO LAND CO                 |               | 4,914     | 6,734   | 7,097   |            | 117,323    | 不動産          |   |   |        |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L |               | 1,010     | 1,605   | 8,570   |            | 141,673    | 公益事業         |   |   |        |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   |               | 5,830     | 8,080   | 23,674  |            | 391,337    | 銀行           |   |   |        |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD |               | 2,230     | 3,165   | 31,206  |            | 515,850    | 資本財          |   |   |        |
| PCCW LTD                     |               | 5,490     | —       | —       |            | —          | 電気通信サービス     |   |   |        |
| XINYI GLASS HOLDINGS LTD     |               | 3,040     | 4,280   | 7,361   |            | 121,687    | 資本財          |   |   |        |
| SANDS CHINA LTD              |               | 4,332     | 5,032   | 7,900   |            | 130,590    | 消費者サービス      |   |   |        |
| WYNN MACAU LTD               |               | 2,864     | —       | —       |            | —          | 消費者サービス      |   |   |        |
| SJM HOLDINGS LTD             |               | 3,650     | —       | —       |            | —          | 消費者サービス      |   |   |        |
| AIA GROUP LTD                |               | 19,970    | 27,914  | 201,120 |            | 3,324,519  | 保険           |   |   |        |
| SWIRE PROPERTIES LTD         |               | 1,740     | 3,056   | 5,671   |            | 93,757     | 不動産          |   |   |        |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L |               | 3,550     | 5,210   | 21,908  |            | 362,140    | 消費者サービス      |   |   |        |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU |               | —         | 4,712   | 5,861   |            | 96,894     | 小売           |   |   |        |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     |               | 6,340     | 8,910   | 10,014  |            | 165,545    | 電気通信サービス     |   |   |        |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS  |               | —         | 2,570   | 6,617   |            | 109,391    | 運輸           |   |   |        |
| WH GROUP LTD                 |               | 15,900    | 20,990  | 11,229  |            | 185,626    | 食品・飲料・タバコ    |   |   |        |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        |               | 4,178     | 4,698   | 24,996  |            | 413,200    | 不動産          |   |   |        |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  |               | 5,015     | 5,015   | 3,891   |            | 64,328     | 公益事業         |   |   |        |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT |               | 2,570     | 3,640   | 13,377  |            | 221,121    | 不動産          |   |   |        |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT |               | 2,855     | 4,244   | 8,471   |            | 140,026    | 食品・飲料・タバコ    |   |   |        |
| ESR CAYMAN LTD               |               | 2,950     | 4,968   | 11,823  |            | 195,448    | 不動産          |   |   |        |
| 小                            | 計             | 株 数 ・ 金 額 | 145,971 | 186,066 | 700,149    | 11,573,475 |              |   |   |        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > |           | 33      | 30      | —          | <0.8%>     |              |   |   |        |
| (シンガポール)                     |               |           |         |         | 千シンガポールドル  |            |              |   |   |        |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP |               | 5,464     | 7,907   | 9,346   |            | 873,016    | 銀行           |   |   |        |
| CAPITALAND LTD               |               | 4,156     | —       | —       |            | —          | 不動産          |   |   |        |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        |               | 1,012     | 1,181   | 932     |            | 87,150     | 不動産          |   |   |        |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       |               | 2,919     | 4,083   | 13,032  |            | 1,217,406  | 銀行           |   |   |        |
| KEPPEL CORP LTD              |               | 2,389     | 3,232   | 2,142   |            | 200,160    | 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             |
| (シンガポール)                     |                            | 百株                 | 百株                 | 千シンガポールドル   | 千円                       |                    |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     |                            | 1,924              | 2,688              | 7,655       | 715,093                  | 銀行                 |
| VENTURE CORP LTD             |                            | 461                | 769                | 1,341       | 125,347                  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   |                            | 2,685              | 3,904              | 1,557       | 145,504                  | 資本財                |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS |                            | 12,959             | 18,457             | 5,223       | 487,927                  | 電気通信サービス           |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       |                            | 2,017              | 2,828              | 1,484       | 138,705                  | 運輸                 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       |                            | 1,336              | 1,805              | 1,694       | 158,320                  | 各種金融               |
| UOL GROUP LTD                |                            | 1,040              | 1,040              | 733         | 68,488                   | 不動産                |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     |                            | 3,069              | 4,043              | 1,698       | 158,615                  | 食品・飲料・タバコ          |
| GENTING SINGAPORE LTD        |                            | 12,345             | 12,345             | 962         | 89,945                   | 消費者サービス            |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI |                            | —                  | 6,408              | 2,486       | 232,245                  | 不動産                |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 53,777<br>14       | 70,691<br>14       | 50,293<br>— | 4,697,927<br><0.3%>      |                    |
| (イスラエル)                      |                            |                    |                    | 千イスラエルシェケル  |                          |                    |
| ICL GROUP LTD                |                            | 1,300              | 1,691              | 6,681       | 251,348                  | 素材                 |
| BANK HAPOLIM BM              |                            | 1,757              | 2,511              | 7,586       | 285,397                  | 銀行                 |
| NICE LTD                     |                            | 97                 | 154                | 9,872       | 371,414                  | ソフトウェア・サービス        |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         |                            | 2,209              | 3,271              | 10,926      | 411,076                  | 銀行                 |
| ELBIT SYSTEMS LTD            |                            | 34                 | 55                 | 3,890       | 146,368                  | 資本財                |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A       |                            | 2,044              | 2,647              | 5,029       | 189,209                  | 銀行                 |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     |                            | 182                | 369                | 4,117       | 154,917                  | 銀行                 |
| AZRIELI GROUP LTD            |                            | 91                 | 92                 | 2,400       | 90,290                   | 不動産                |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 7,718<br>8         | 10,794<br>8        | 50,504<br>— | 1,900,024<br><0.1%>      |                    |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 1,797,058<br>1,226 | 2,452,415<br>1,227 | —<br>—      | 1,392,087,914<br><94.9%> |                    |

(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    | 92        | 122   | 3,626   | 470,562   | 0.0        |   |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 21        | 33    | 5,424   | 703,946   | 0.0        |   |
| PROLOGIS INC                 | 122       | 170   | 21,048  | 2,731,405 | 0.2        |   |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 15        | 24    | 3,526   | 457,691   | 0.0        |   |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 46        | 64    | 8,160   | 1,059,006 | 0.1        |   |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 27        | 40    | 2,764   | 358,766   | 0.0        |   |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 10        | 15    | 4,430   | 574,916   | 0.0        |   |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 20        | 30    | 5,357   | 695,281   | 0.0        |   |
| WELLTOWER INC                | 67        | 101   | 8,800   | 1,141,986 | 0.1        |   |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 23        | 32    | 3,568   | 463,090   | 0.0        |   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 94        | 144   | 2,530   | 328,431   | 0.0        |   |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 18        | 26    | 4,675   | 606,754   | 0.0        |   |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 37        | —     | —       | —         | —          |   |
| REALTY INCOME CORP           | 56        | 131   | 8,376   | 1,087,025 | 0.1        |   |
| REGENCY CENTERS CORP         | 30        | 34    | 2,256   | 292,771   | 0.0        |   |
| SUN COMMUNITIES INC          | 17        | 26    | 4,125   | 535,415   | 0.0        |   |
| UDR INC                      | 51        | 72    | 3,429   | 445,062   | 0.0        |   |
| VENTAS INC                   | 60        | 91    | 4,845   | 628,858   | 0.0        |   |
| WEYERHAEUSER CO              | 124       | 169   | 6,406   | 831,307   | 0.1        |   |
| AMERICAN TOWER CORP          | 73        | 104   | 23,540  | 3,054,914 | 0.2        |   |
| WP CAREY INC                 | 28        | 41    | 3,194   | 414,536   | 0.0        |   |
| VEREIT INC                   | 36        | —     | —       | —         | —          |   |
| DUKE REALTY CORP             | 59        | 88    | 4,711   | 611,402   | 0.0        |   |
| IRON MOUNTAIN INC            | 48        | 69    | 3,493   | 453,379   | 0.0        |   |
| EQUINIX INC                  | 14        | 20    | 12,949  | 1,680,395 | 0.1        |   |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 71        | 99    | 16,974  | 2,202,813 | 0.2        |   |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 60        | 79    | 5,878   | 762,842   | 0.1        |   |
| INVITATION HOMES INC         | 92        | 140   | 5,041   | 654,295   | 0.0        |   |
| VICI PROPERTIES INC          | 92        | 214   | 5,871   | 761,938   | 0.1        |   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 18        | 25    | 7,958   | 1,032,812 | 0.1        |   |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 113       | 170   | 3,281   | 425,785   | 0.0        |   |
| PUBLIC STORAGE               | 26        | 36    | 11,352  | 1,473,200 | 0.1        |   |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 54        | 74    | 8,372   | 1,086,464 | 0.1        |   |
| VORNADO REALTY TRUST         | 26        | 33    | 1,148   | 148,982   | 0.0        |   |
| KIMCO REALTY CORP            | —         | 135   | 2,999   | 389,283   | 0.0        |   |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 22        | 32    | 6,668   | 865,390   | 0.1        |   |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額 | 1,781 | 2,698   | 226,791   | 29,430,720 |   |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |           | 35    | 34      | —         | <2.0%>     |   |
| (カナダ)                        |           |       | 千カナダドル  |           |            |   |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 14        | 23    | 1,075   | 107,477   | 0.0        |   |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 30        | 30    | 652     | 65,188    | 0.0        |   |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額 | 45    | 54      | 1,727     | 172,666    |   |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |           | 2     | 2       | —         | <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     |     |
| (ユーロ…フランス)                   |               | 千口      | 千口     | 千ユーロ       | 千円         | %   |
| GECINA SA                    |               | 7       | 9      | 942        | 128,753    | 0.0 |
| KLEPIERRE                    |               | 28      | 53     | 1,198      | 163,658    | 0.0 |
| COVIVIO                      |               | 9       | 13     | 865        | 118,272    | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    |               | —       | 27     | 1,922      | 262,516    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 45      | 102    | 4,928      | 673,201    |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 4      | —          | <0.0%>     |     |
| (ユーロ…オランダ)                   |               |         |        |            |            |     |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    |               | 22      | —      | —          | —          | —   |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 22      | —      | —          | —          |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1       | —      | —          | <—%>       |     |
| ユ ー ロ 計                      | 口 数 ・ 金 額     | 67      | 102    | 4,928      | 673,201    |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 4      | —          | <0.0%>     |     |
| (イギリス)                       |               |         |        | 千イギリスポンド   |            |     |
| BRITISH LAND CO PLC          |               | 132     | 174    | 852        | 135,544    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |               | 120     | 155    | 1,112      | 176,754    | 0.0 |
| SEGRO PLC                    |               | 187     | 260    | 2,898      | 460,587    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 439     | 590    | 4,863      | 772,886    |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 3      | —          | <0.1%>     |     |
| (オーストラリア)                    |               |         |        | 千オーストラリアドル |            |     |
| VICINITY CENTRES             |               | 685     | 995    | 1,782      | 160,562    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                |               | 825     | 1,280  | 3,545      | 319,333    | 0.0 |
| DEXUS/AU                     |               | —       | 256    | 2,732      | 246,123    | 0.0 |
| GPT GROUP                    |               | 311     | 401    | 1,919      | 172,845    | 0.0 |
| MIRVAC GROUP                 |               | 610     | 900    | 1,989      | 179,189    | 0.0 |
| STOCKLAND                    |               | 364     | 543    | 2,096      | 188,786    | 0.0 |
| DEXUS                        |               | 172     | —      | —          | —          | —   |
| GOODMAN GROUP                |               | 281     | 377    | 7,359      | 662,777    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 3,251   | 4,755  | 21,425     | 1,929,617  |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 7       | 7      | —          | <0.1%>     |     |
| (香港)                         |               |         |        | 千香港ドル      |            |     |
| LINK REIT                    |               | 335     | 462    | 30,762     | 508,510    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 335     | 462    | 30,762     | 508,510    |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1       | 1      | —          | <0.0%>     |     |
| (シンガポール)                     |               |         |        | 千シンガポールドル  |            |     |
| SUNTEC REIT                  |               | 254     | —      | —          | —          | —   |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS       |               | —       | 18     | 23         | 2,209      | 0.0 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST    |               | 478     | 704    | 1,162      | 108,612    | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   |               | 383     | 383    | 686        | 64,139     | 0.0 |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER |               | 763     | 1,054  | 2,362      | 220,698    | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |               | 593     | 742    | 2,042      | 190,808    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 2,473   | 2,904  | 6,278      | 586,469    |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5      | —          | <0.0%>     |     |
| 合 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 8,395   | 11,568 | —          | 34,074,072 |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 57      | 56     | —          | <2.3%>     |     |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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     |     | 期末  |
|-----|--------|----------|--------|-----|-----|
|     |        |          | 買建額    | 売建額 | 額   |
| 外国  | 株式先物取引 | SP EMINI | 百万円    |     | 百万円 |
|     |        | SP/TSE60 | 28,255 |     | —   |
|     |        | SWISS IX | 1,489  |     | —   |
|     |        | EURO ST  | 1,127  |     | —   |
|     |        | SPI 200  | 4,502  |     | —   |
|     |        | FTSE100  | 1,395  |     | —   |
|     |        |          | 5,848  |     | —   |

(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

(2022年5月12日現在)

| 項目           | 当期            |       | 期末 |
|--------------|---------------|-------|----|
|              | 評価額           | 比率    |    |
| 株式           | 千円            | %     |    |
|              | 1,392,087,914 | 92.4  |    |
| 投資証券         | 34,074,072    | 2.3   |    |
| コール・ローン等、その他 | 80,376,293    | 5.3   |    |
| 投資信託財産総額     | 1,506,538,279 | 100.0 |    |

(注) 期末における外貨建純資産（1,458,398,210千円）の投資信託財産総額（1,506,538,279千円）に対する比率は96.8%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=129.77円     | 1 カナダドル=99.93円      | 1 ユーロ=136.58円      | 1 イギリスポンド=158.93円  |
| 1 スイスフラン=130.55円     | 1 スウェーデンクローネ=12.89円 | 1 ノルウェークローネ=13.33円 | 1 デンマーククローネ=18.36円 |
| 1 オーストラリアドル=90.06円   | 1 ニュージーランドドル=81.68円 | 1 香港ドル=16.53円      | 1 シンガポールドル=93.41円  |
| 1 イスラエルシェケル=37.6208円 |                     |                    |                    |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

| 項 目             | 当 期 末             |
|-----------------|-------------------|
|                 | 円                 |
| (A) 資産          | 1,517,229,422,256 |
| コール・ローン等        | 70,030,049,068    |
| 株式(評価額)         | 1,392,087,914,213 |
| 投資証券(評価額)       | 34,074,072,939    |
| 未収入金            | 10,836,245,826    |
| 未収配当金           | 1,502,546,993     |
| 差入委託証拠金         | 8,698,593,217     |
| (B) 負債          | 50,730,845,137    |
| 未払金             | 49,893,403,669    |
| 未払解約金           | 837,440,222       |
| 未払利息            | 1,246             |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 1,466,498,577,119 |
| 元本              | 334,911,394,157   |
| 次期繰越損益金         | 1,131,587,182,962 |
| (D) 受益権総口数      | 334,911,394,157口  |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 43,788円           |

<注記事項>

- ①期首元本額 246,268,186,550円  
期中追加設定元本額 199,211,865,714円  
期中一部解約元本額 110,568,658,107円  
また、1口当たり純資産額は、期末4.3788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)

|                                  |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)     | 94,233,926,773円 |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス          | 70,746,294,503円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)          | 26,498,007,853円 |
| 三菱UFJ D C海外株式インデックスファンド          | 25,312,656,195円 |
| つみたて先進国株式                        | 14,775,468,769円 |
| eMAXIS 先進国株式インデックス               | 12,837,380,145円 |
| MUAM 外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)   | 11,702,503,566円 |
| 三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)      | 9,462,451,954円  |
| 三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)    | 9,335,258,850円  |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド         | 6,293,111,848円  |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)  | 6,114,273,650円  |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)    | 4,847,697,085円  |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)         | 3,904,950,205円  |
| eMAXIS 全世界株式インデックス               | 3,652,532,624円  |
| MAXIS 海外株式(MSC I コクサイ) 上場投信      | 3,076,596,742円  |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式               | 2,747,752,302円  |
| MAXIS 全世界株式(オール・カントリー) 上場投信      | 2,595,691,846円  |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定) | 2,369,312,402円  |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド             | 2,343,768,099円  |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)      | 1,886,856,271円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 1,776,556,437円  |

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

| 項 目                | 当 期               |
|--------------------|-------------------|
|                    | 円                 |
| (A) 配当等収益          | 22,159,905,235    |
| 受取配当金              | 22,172,235,907    |
| 受取利息               | 30,769            |
| その他収益金             | 29,973,129        |
| 支払利息               | △ 42,334,570      |
| (B) 有価証券売買損益       | 80,201,678,804    |
| 売買益                | 279,588,654,169   |
| 売買損                | △ 199,386,975,365 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 1,248,529,460   |
| 取引益                | 13,190,364,923    |
| 取引損                | △ 14,438,894,383  |
| (D) 保管費用等          | △ 336,579,796     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 100,776,474,783   |
| (F) 前期繰越損益金        | 728,436,269,763   |
| (G) 追加信託差損益金       | 681,567,944,290   |
| (H) 解約差損益金         | △ 379,193,505,874 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 1,131,587,182,962 |
| 次期繰越損益金(I)         | 1,131,587,182,962 |

(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。

|                                       |                |
|---------------------------------------|----------------|
| 三菱UFJ ブライムバランス（安定型）（確定拠出年金）           | 1,675,341,256円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）               | 1,604,997,913円 |
| 三菱UFJ ブライムバランス（8資産）（確定拠出年金）           | 1,559,787,082円 |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）                     | 1,555,842,420円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）                   | 1,069,859,603円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）              | 940,816,779円   |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）       | 901,001,461円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）                | 811,165,830円   |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）         | 712,300,269円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式65）                  | 556,087,445円   |
| つみたて4資産均等バランス                         | 548,574,630円   |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）              | 529,836,115円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付） | 460,879,156円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）   | 424,905,172円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）   | 423,165,268円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）   | 414,396,998円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型） | 406,215,898円   |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）             | 376,429,787円   |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）            | 348,429,134円   |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）                   | 275,930,411円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式40）                  | 274,669,499円   |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）               | 273,302,000円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                     | 256,580,820円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）                | 218,843,457円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）      | 161,343,504円   |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）                | 139,743,754円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）      | 121,511,419円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）      | 121,261,840円   |
| 先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）                | 111,434,614円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）      | 109,559,979円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）   | 100,043,396円   |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）             | 99,341,023円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）      | 91,863,526円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）             | 80,823,029円    |
| つみたて全世界株式                             | 75,451,183円    |
| アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）       | 64,872,362円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）       | 61,668,365円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）      | 59,426,073円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）             | 58,184,228円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）            | 53,230,144円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）      | 52,697,288円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式15）                  | 38,624,992円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25）                  | 33,090,986円    |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA                | 32,051,015円    |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）            | 19,440,584円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）      | 19,223,316円    |
| ファンド・マネジャー（海外株式）                      | 16,714,109円    |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）            | 15,995,017円    |
| アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）        | 10,457,821円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）         | 10,114,249円    |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s                 | 3,399,876円     |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA          | 2,912,794円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                 | 2,607,408円     |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA            | 2,245,227円     |

|                                       |                  |
|---------------------------------------|------------------|
| 三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式80）                  | 1,782,940円       |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）            | 1,735,210円       |
| 三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）            | 1,589,027円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                 | 1,463,348円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ            | 1,434,803円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ            | 855,152円         |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）       | 623,458円         |
| コアバランス                                | 135,443円         |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）            | 20,140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） | 14,993円          |
| 合計                                    | 334,911,394,157円 |

【お 知 ら せ】

信託金限度額の増額を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2021年5月17日)

## 三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

## 《繰上償還(第22期)》信託終了日2021年12月27日

[計算期間：2021年5月21日～2021年12月27日]

「三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド」は、この度、約款の規定に基づき、12月27日に繰り上げて償還させていただきます。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第22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<br>(配当込み、円換算ベース) |                | 株<br>組 入 比 率 | 株<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 券 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|-----------|----------------|-----------------------------------|----------------|--------------|--------------|------------------------|--------------|
|                  | 円 銭       | 期 騰 落 中 率<br>% | 期 騰 落 中 率<br>%                    | 期 騰 落 中 率<br>% | 式 率<br>%     | 式 率<br>%     | 式 率<br>%               | 百 万 円        |
| 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       |
| 21期(2021年5月20日)  | 34,278    | 46.4           | 1,088,325.89                      | 46.1           | 95.5         | 2.4          | 2.1                    | 115,732      |
| (償還時)            | (償還価額)    |                |                                   |                |              |              |                        |              |
| 22期(2021年12月27日) | 38,788.92 | 13.2           | 1,272,947.67                      | 17.0           | —            | —            | —                      | 3,970        |

(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             | MSC I コクサイ・インデックス |                | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 入 比 率 |
|-----------------------|---------------------|-------------------|----------------|-----------|-----------|-----------------|
|                       |                     | 騰 落 率             | ( 配当込み、円換算ベース) |           |           |                 |
| (期 首)<br>2021年 5 月20日 | 円 銭<br>34,278       | %<br>—            | 1,088,325.89   | %<br>—    | %<br>95.5 | %<br>2.4        |
| 5 月末                  | 35,307              | 3.0               | 1,120,295.08   | 2.9       | 94.5      | 3.4             |
| 6 月末                  | 36,188              | 5.6               | 1,148,321.00   | 5.5       | 93.6      | 3.1             |
| 7 月末                  | 36,702              | 7.1               | 1,164,636.70   | 7.0       | 94.1      | 2.8             |
| 8 月末                  | 37,608              | 9.7               | 1,193,049.12   | 9.6       | 95.0      | 2.3             |
| 9 月末                  | 36,733              | 7.2               | 1,165,043.55   | 7.0       | 97.8      | 3.3             |
| 10月末                  | 38,740              | 13.0              | 1,250,124.47   | 14.9      | 0.0       | —               |
| 11月末                  | 38,740              | 13.0              | 1,244,334.35   | 14.3      | —         | —               |
| (償還時)<br>2021年12月27日  | (償還価額)<br>38,788.92 | 13.2              | 1,272,947.67   | 17.0      | —         | —               |

(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

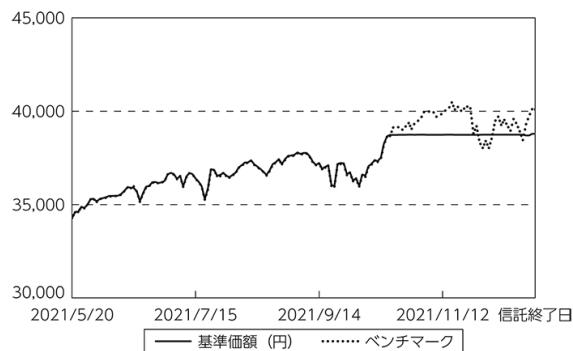
## ◎基準価額の動き

償還価額は期首に比べ13.2%の上昇となりました。

## ◎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(17.0%)を3.8%下回りました。

## 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

(上昇要因)

- ・期首から償還に向け保有資産を売却し始めた2021年10月中旬までは、基準価額はベンチマークに連動した動きとなりました。
- ・10月中旬から信託終了日にかけては、基準価額はほぼ横ばいの動きとなりました。

## ●投資環境について

### ◎外国株式市況

- ・外国株式市況は上昇しました。
- ・外国株式市況は、米国の金融緩和維持の姿勢や、堅調な経済指標や企業決算等が支援材料となり上昇しました。

### ◎為替市況

- ・米ドルは円に対して上昇、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

- ・第22期（2021年5月21日～信託終了日）は、前記の運用を維持しましたが、2021年10月中旬に保有資産の売却を行いました。

## ●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17.0%の上昇になったため、カイ離はΔ3.8%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)

- ・ありません。

(主なマイナス要因)

- ・組入要因※によるものです。

※償還に向け保有資産を売却した後、ベンチマークが上昇したことによる要因などが含まれます。

## ●償還価額

- ・償還価額は、38,788円92銭となりました。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月21日～2021年12月27日)

| 項 目                   | 当 期   |         | 項 目 の 概 要                                                                              |
|-----------------------|-------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額   | 比 率     |                                                                                        |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円 1   | % 0.003 | (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>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 ) | (0.002) |                                                                                        |
| (投 資 信 託 証 券)         | ( 0 ) | (0.000) |                                                                                        |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)     | ( 0 ) | (0.001) |                                                                                        |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2     | 0.004   | (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>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (株 式)                 | ( 2 ) | (0.004) |                                                                                        |
| (投 資 信 託 証 券)         | ( 0 ) | (0.000) |                                                                                        |
| (c) そ の 他 費 用         | 19    | 0.051   | (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>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<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (13)  | (0.036) |                                                                                        |
| (そ の 他)               | ( 6 ) | (0.015) |                                                                                        |
| 合 計                   | 22    | 0.058   |                                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、37,227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

(2021年5月21日～2021年12月27日)

## 株式

|     |          | 買 付                    |                                | 売 付                    |                                    |
|-----|----------|------------------------|--------------------------------|------------------------|------------------------------------|
|     |          | 株 数                    | 金 額                            | 株 数                    | 金 額                                |
| 外 国 | アメリカ     | 百株<br>3,212<br>(△ 361) | 千アメリカドル<br>33,876<br>( 665)    | 百株<br>65,600<br>( 232) | 千アメリカドル<br>824,024<br>( 1,685)     |
|     | カナダ      | 398<br>( 1)            | 千カナダドル<br>2,007<br>(△ 12)      | 8,543                  | 千カナダドル<br>51,533                   |
|     | ユーロ      |                        | 千ユーロ                           |                        | 千ユーロ                               |
|     | ドイツ      | 205<br>( 83)           | 862<br>( 59)                   | 5,159                  | 27,329                             |
|     | イタリア     | 236<br>( —)            | 190<br>(△0.70042)              | 10,591                 | 5,598                              |
|     | フランス     | 227<br>( 222)          | 1,062<br>( —)                  | 5,665                  | 31,545                             |
|     | オランダ     | 189<br>( 138)          | 1,248<br>( —)                  | 4,235                  | 18,973                             |
|     | スペイン     | 434<br>( 2,143)        | 491<br>( 43)                   | 11,816                 | 7,547                              |
|     | ベルギー     | 11                     | 57                             | 417                    | 2,505                              |
|     | オーストリア   | 8                      | 28                             | 154                    | 657                                |
|     | ルクセンブルク  | 49                     | 86                             | 608                    | 1,030                              |
|     | フィンランド   | 120                    | 158                            | 2,011                  | 3,202                              |
|     | アイルランド   | 5                      | 67                             | 308                    | 2,132                              |
|     | ポルトガル    | —                      | —                              | 730                    | 477                                |
|     | イギリス     | 1,606<br>(△ 20)        | 千イギリスポンド<br>1,136<br>( 332)    | 60,214<br>( 211)       | 千イギリスポンド<br>37,165<br>( 170)       |
|     | スイス      | 103<br>( —)            | 千スイスフラン<br>975<br>(△ 3)        | 3,575                  | 千スイスフラン<br>31,611                  |
|     | スウェーデン   | 432<br>( 378)          | 千スウェーデンクローネ<br>8,151<br>( 758) | 6,841<br>( 367)        | 千スウェーデンクローネ<br>115,795<br>( 1,697) |
|     | ノルウェー    | 43                     | 千ノルウェークローネ<br>875              | 1,218                  | 千ノルウェークローネ<br>20,725               |
|     | デンマーク    | 58                     | 千デンマーククローネ<br>2,209            | 1,112                  | 千デンマーククローネ<br>61,542               |
|     | オーストラリア  | 484<br>( 316)          | 千オーストラリアドル<br>1,122<br>( 2)    | 15,396<br>( —)         | 千オーストラリアドル<br>31,497<br>( 2)       |
|     | ニュージーランド | 93                     | 千ニュージーランドドル<br>85              | 1,461                  | 千ニュージーランドドル<br>1,233               |

|        |        | 買 付                   |                            | 売 付               |                              |
|--------|--------|-----------------------|----------------------------|-------------------|------------------------------|
|        |        | 株 数                   | 金 額                        | 株 数               | 金 額                          |
| 外<br>国 | 香港     | 百株<br>1,463<br>( 100) | 千香港ドル<br>3,882<br>(△ 8)    | 百株<br>19,180      | 千香港ドル<br>75,865              |
|        | シンガポール | 340<br>( 1,089)       | 千シンガポールドル<br>178<br>( 104) | 6,634<br>( 1,089) | 千シンガポールドル<br>4,350<br>( 158) |
|        | イスラエル  | —                     | 千イスラエルシェケル<br>—            | 1,012             | 千イスラエルシェケル<br>4,423          |

(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      |
| 外国                           | 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    | —      | —       | 11     | 381     |
|                              | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 0.271  | 55      | 2      | 595     |
|                              | PROLOGIS INC                 | 0.371  | 46      | 15     | 2,124   |
|                              | CAMDEN PROPERTY TRUST        | —      | —       | 1      | 315     |
|                              | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 0.228  | 33      | 5      | 842     |
|                              | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | —      | —       | 3      | 277     |
|                              | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | —      | —       | 1      | 454     |
|                              | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 0.199  | 34      | 2      | 531     |
|                              | WELLTOWER INC                | 0.407  | 34      | 8      | 704     |
|                              | BOSTON PROPERTIES INC        | —      | —       | 2      | 343     |
|                              | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | —      | —       | 11     | 243     |
|                              | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | —      | —       | 2      | 455     |
|                              | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | —      | —       | 5      | 159     |
|                              | REALTY INCOME CORP           | —      | —       | 7      | 512     |
|                              | REGENCY CENTERS CORP         | —      | —       | 3      | 223     |
|                              | SUN COMMUNITIES INC          | 0.281  | 56      | 2      | 454     |
|                              | UDR INC                      | 0.64   | 34      | 6      | 341     |
|                              | VENTAS INC                   | 0.712  | 40      | 8      | 472     |
|                              | WEYERHAEUSER CO              | —      | —       | 15     | 565     |
|                              | AMERICAN TOWER CORP          | 0.421  | 118     | 9      | 2,500   |
|                              | WP CAREY INC                 | 0.452  | 33      | 3      | 288     |
|                              | VEREIT INC                   | 0.67   | 31      | 4      | 230     |
|                              | DUKE REALTY CORP             | —      | —       | 7      | 413     |
|                              | IRON MOUNTAIN INC            | —      | —       | 5      | 263     |
|                              | EQUINIX INC                  | 0.042  | 33      | 1      | 1,406   |
|                              | CROWN CASTLE INTL CORP       | 0.251  | 44      | 8      | 1,499   |
|                              | EQUITY RESIDENTIAL           | 0.538  | 43      | 7      | 666     |
|                              | INVITATION HOMES INC         | 0.874  | 34      | 11     | 477     |
|                              | VICI PROPERTIES INC          | 1      | 43      | 12     | 370     |
|                              | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 0.119  | 39      | 2      | 770     |
|                              | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 1      | 33      | 14     | 252     |
|                              | PUBLIC STORAGE               | —      | —       | 3      | 1,013   |
|                              | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 0.251  | 33      | 6      | 965     |
|                              | VORNADO REALTY TRUST         | 0.76   | 32      | 3      | 158     |
|                              | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | —      | —       | 2      | 656     |
| 小計                           | 10                           | 857    | 225     | 21,934 |         |
| カナダ                          |                              | 千カナダドル |         | 千カナダドル |         |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | —                            | —      | 1       | 101    |         |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | —                            | —      | 4       | 92     |         |
| 小計                           | —                            | —      | 5       | 193    |         |

| 銘柄 |                              | 買付     |            | 売付    |            |
|----|------------------------------|--------|------------|-------|------------|
|    |                              | 口数     | 金額         | 口数    | 金額         |
| 外国 | ユーロ                          | 千口     | 千ユーロ       | 千口    | 千ユーロ       |
|    | フランス                         |        |            |       |            |
|    | GECINA SA                    | 0.199  | 25         | 0.914 | 109        |
|    | KLEPIERRE                    | —      | —          | 4     | 77         |
|    |                              | ( —)   | (△ 4)      |       |            |
|    | COVIVIO                      | —      | —          | 1     | 84         |
|    | 小計                           | 0.199  | 25         | 6     | 271        |
|    |                              | ( —)   | (△ 4)      |       |            |
|    | オランダ                         |        |            |       |            |
|    | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | —      | —          | 2     | 185        |
|    | 小計                           | —      | —          | 2     | 185        |
|    | ユーロ計                         | 0.199  | 25         | 9     | 457        |
|    |                              | ( —)   | (△ 4)      |       |            |
|    | イギリス                         |        | 千イギリスポンド   |       | 千イギリスポンド   |
|    | BRITISH LAND CO PLC          | —      | —          | 15    | 76         |
|    | LAND SECURITIES GROUP PLC    | —      | —          | 15    | 109        |
|    | SEGRO PLC                    | —      | —          | 24    | 316        |
|    | 小計                           | —      | —          | 55    | 501        |
|    | 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             | —      | —          | 88    | 156        |
|    | SCENTRE GROUP                | —      | —          | 103   | 311        |
|    | DEXUS/AU                     | 4      | 45         | 22    | 238        |
|    |                              | ( 18)  | ( 182)     |       |            |
|    | GPT GROUP                    | 8      | 40         | 41    | 209        |
|    | MIRVAC GROUP                 | 14     | 43         | 83    | 236        |
|    | STOCKLAND                    | —      | —          | 45    | 208        |
|    | DEXUS                        | —      | —          | —     | —          |
|    |                              | (△ 18) | (△ 182)    |       |            |
|    | GOODMAN GROUP                | 2      | 43         | 34    | 719        |
|    | 小計                           | 29     | 173        | 418   | 2,080      |
|    | 香港                           |        | 千香港ドル      |       | 千香港ドル      |
|    | LINK REIT                    | —      | —          | 42    | 2,874      |
|    | 小計                           | —      | —          | 42    | 2,874      |
|    | 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                  | —      | —          | 48    | 69         |
|    | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | —      | —          | 64    | 129        |
|    |                              | ( —)   | (△ 0.2892) |       |            |
|    | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | —      | —          | 45    | 97         |
|    | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | —      | —          | 92    | 196        |
|    |                              | ( 6)   | ( 10)      |       |            |
|    | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | —      | —          | 73    | 220        |
|    |                              | ( —)   | (△0.41431) |       |            |
|    | 小計                           | —      | —          | 325   | 712        |
|    | ( 6)                         | ( 10)  |            |       |            |

(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<br>14,854 | 百万円<br>17,995 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月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

(2021年5月21日～2021年12月27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       | 134,012,843千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 97,786,013千円  |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.37          |

(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

(2021年5月21日～2021年12月27日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        | 百万円       | 百万円                | %             | 百万円       | 百万円                | %             |
| 為替直物取引 | 11,092    | 10,812             | 97.5          | 142,015   | 138,970            | 97.9          |

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MUFG証券です。

## ○組入資産の明細

(2021年12月27日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

## 外国株式

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     |
|------------------------------|---------|-----|
|                              | 株       | 数   |
| (アメリカ)                       |         | 百株  |
| AMERICAN EXPRESS CO          |         | 137 |
| ABBOTT LABORATORIES          |         | 354 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     |         | 60  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    |         | 85  |
| AES CORP                     |         | 136 |
| AFLAC INC                    |         | 133 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP |         | 168 |
| ADVANCED MICRO DEVICES       |         | 240 |
| ACCENTURE PLC-CL A           |         | 127 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC |         | 44  |
| ANTHEM INC                   |         | 49  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       |         | 285 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     |         | 102 |
| BOEING CO/THE                |         | 107 |
| BECTON DICKINSON AND CO      |         | 58  |
| BEST BUY CO INC              |         | 48  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      |         | 451 |
| BLACKROCK INC                |         | 30  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   |         | 829 |
| BALL CORP                    |         | 68  |
| ALLSTATE CORP                |         | 59  |
| AVERY DENNISON CORP          |         | 17  |
| CHUBB LTD                    |         | 90  |
| ANALOG DEVICES INC           |         | 73  |
| AUTOZONE INC                 |         | 4   |
| CVS HEALTH CORP              |         | 261 |
| CORNING INC                  |         | 158 |
| JPMORGAN CHASE & CO          |         | 609 |
| CATERPILLAR INC              |         | 108 |
| COCA-COLA CO/THE             |         | 817 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   |         | 90  |
| CAMPBELL SOUP CO             |         | 34  |
| CSX CORP                     |         | 153 |
| CHEVRON CORP                 |         | 385 |
| CONOCOPHILLIPS               |         | 270 |
| CME GROUP INC                |         | 71  |
| CARDINAL HEALTH INC          |         | 55  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         |         | 163 |
| DOMINION ENERGY INC          |         | 161 |
| DEVON ENERGY CORP            |         | 112 |
| DEERE & CO                   |         | 59  |
| DANAHER CORP                 |         | 127 |
| WALT DISNEY CO/THE           |         | 362 |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       |
|------------------------------|---------|-------|
|                              | 株       | 数     |
| (アメリカ)                       |         | 百株    |
| DARDEN RESTAURANTS INC       |         | 26    |
| DUKE ENERGY CORP             |         | 147   |
| DR HORTON INC                |         | 71    |
| TARGET CORP                  |         | 100   |
| DAVITA INC                   |         | 16    |
| DOVER CORP                   |         | 27    |
| DTE ENERGY COMPANY           |         | 39    |
| EXXON MOBIL CORP             |         | 846   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    |         | 123   |
| EOG RESOURCES INC            |         | 115   |
| EMERSON ELECTRIC CO          |         | 119   |
| EXELON CORP                  |         | 195   |
| ECOLAB INC                   |         | 53    |
| EQUIFAX INC                  |         | 24    |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  |         | 45    |
| EATON CORP PLC               |         | 79    |
| EDISON INTERNATIONAL         |         | 72    |
| ENTERGY CORP                 |         | 38    |
| EVEREST RE GROUP LTD         |         | 8     |
| NEXTERA ENERGY INC           |         | 392   |
| FEDEX CORP                   |         | 49    |
| FORD MOTOR CO                |         | 777   |
| FRANKLIN RESOURCES INC       |         | 60    |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC |         | 7     |
| FIRSTENERGY CORP             |         | 112   |
| FREEPORT-MCMORAN INC         |         | 291   |
| GENERAL MILLS INC            |         | 119   |
| GENERAL DYNAMICS CORP        |         | 48    |
| VW GRAINGER INC              |         | 8     |
| GENERAL ELECTRIC CO          |         | 1,751 |
| GLOBAL PAYMENTS INC          |         | 60    |
| GENUINE PARTS CO             |         | 26    |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      |         | 65    |
| HALLIBURTON CO               |         | 178   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  |         | 140   |
| HP INC                       |         | 281   |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  |         | 70    |
| HERSHEY CO/THE               |         | 29    |
| HOME DEPOT INC               |         | 215   |
| HASBRO INC                   |         | 26    |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       |         | 47    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  |         | 178   |
| INTERNATIONAL PAPER CO       |         | 71    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |    |
|------------------------------|---------|----|
|                              | 株       | 数  |
| (アメリカ)                       |         | 百株 |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 63      |    |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 76      |    |
| IDEX CORP                    | 15      |    |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 45      |    |
| JOHNSON & JOHNSON            | 526     |    |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 19      |    |
| KELLOGG CO                   | 54      |    |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 66      |    |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 287     |    |
| KROGER CO                    | 148     |    |
| ELI LILLY & CO               | 172     |    |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 20      |    |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 31      |    |
| LENNAR CORP-A                | 54      |    |
| LOWE'S COS INC               | 146     |    |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 64      |    |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 50      |    |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 39      |    |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 6       |    |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 54      |    |
| MCDONALD'S CORP              | 149     |    |
| S&P GLOBAL INC               | 48      |    |
| MEDTRONIC PLC                | 269     |    |
| MERCK & CO. INC.             | 505     |    |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 222     |    |
| 3M CO                        | 115     |    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 32      |    |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 98      |    |
| MASCO CORP                   | 53      |    |
| M & T BANK CORP              | 26      |    |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 101     |    |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 10      |    |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 12      |    |
| MORGAN STANLEY               | 281     |    |
| MCKESSON CORP                | 32      |    |
| METLIFE INC                  | 153     |    |
| MOODY'S CORP                 | 33      |    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 50      |    |
| BANK OF AMERICA CORP         | 1,557   |    |
| NISOURCE INC                 | 76      |    |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 31      |    |
| NEWMONT CORP                 | 166     |    |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 48      |    |
| MARKEL CORP                  | 2       |    |
| NUCOR CORP                   | 58      |    |
| NEWELL BRANDS INC            | 85      |    |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 190     |    |
| OMNICOM GROUP                | 39      |    |
| PEPSICO INC                  | 277     |    |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 19      |    |
| ALTRIA GROUP INC             | 372     |    |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 23      |    |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 496     |    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |    |
|------------------------------|---------|----|
|                              | 株       | 数  |
| (アメリカ)                       |         | 百株 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 84      |    |
| PFIZER INC                   | 1,111   |    |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 77      |    |
| PULTEGROUP INC               | 54      |    |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 26      |    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 41      |    |
| CITIGROUP INC                | 416     |    |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 57      |    |
| PPG INDUSTRIES INC           | 48      |    |
| PENTAIR PLC                  | 34      |    |
| P G & E CORP                 | 277     |    |
| PPL CORP                     | 157     |    |
| PROGRESSIVE CORP             | 117     |    |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 102     |    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 48      |    |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 43      |    |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 198     |    |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD     | 10      |    |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 21      |    |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 111     |    |
| ROBERT HALF INTL INC         | 21      |    |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 22      |    |
| SCHLUMBERGER LTD             | 272     |    |
| STRYKER CORP                 | 67      |    |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 305     |    |
| SEMPRA ENERGY                | 56      |    |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 49      |    |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 31      |    |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 49      |    |
| SOUTHERN CO/THE              | 211     |    |
| AT&T INC                     | 1,427   |    |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 63      |    |
| STATE STREET CORP            | 67      |    |
| SYSCO CORP                   | 95      |    |
| SEALED AIR CORP              | 31      |    |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 183     |    |
| TERADYNE INC                 | 33      |    |
| GLOBE LIFE INC               | 18      |    |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 145     |    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 79      |    |
| TEXTRON INC                  | 46      |    |
| UNION PACIFIC CORP           | 134     |    |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP   | 304     |    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 189     |    |
| US BANCORP                   | 271     |    |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 143     |    |
| VALERO ENERGY CORP           | 84      |    |
| VIACOMCBS INC - CLASS B      | 114     |    |
| VF CORP                      | 68      |    |
| VULCAN MATERIALS CO          | 25      |    |
| WILLIAMS COS INC             | 232     |    |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 146     |    |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 65      |    |

| 銘柄                          | 期首(前期末) |       |
|-----------------------------|---------|-------|
|                             | 株       | 数     |
| (アメリカ)                      |         | 百株    |
| WALMART INC                 |         | 283   |
| WELLS FARGO & CO            |         | 786   |
| WASTE MANAGEMENT INC        |         | 83    |
| WATERS CORP                 |         | 12    |
| WHIRLPOOL CORP              |         | 13    |
| XCEL ENERGY INC             |         | 107   |
| KEYCORP                     |         | 183   |
| CARMAX INC                  |         | 34    |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC  |         | 40    |
| YUM! BRANDS INC             |         | 59    |
| TJX COMPANIES INC           |         | 239   |
| CLOROX COMPANY              |         | 25    |
| CELANESE CORP               |         | 23    |
| CADENCE DESIGN SYS INC      |         | 58    |
| CARNIVAL CORP               |         | 145   |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV |         | 124   |
| CONAGRA BRANDS INC          |         | 92    |
| CONSOLIDATED EDISON INC     |         | 68    |
| FIFTH THIRD BANCORP         |         | 139   |
| INTEL CORP                  |         | 819   |
| CISCO SYSTEMS INC           |         | 844   |
| CINTAS CORP                 |         | 18    |
| COSTCO WHOLESALE CORP       |         | 88    |
| APPLIED MATERIALS INC       |         | 182   |
| ELECTRONIC ARTS INC         |         | 56    |
| TYSON FOODS INC-CL A        |         | 62    |
| NORTONLIFELOCK INC          |         | 112   |
| ROSS STORES INC             |         | 71    |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC    |         | 51    |
| NIKE INC -CL B              |         | 250   |
| EXACT SCIENCES CORP         |         | 32    |
| AMGEN INC                   |         | 116   |
| NORTHERN TRUST CORP         |         | 38    |
| MICROSOFT CORP              |         | 1,436 |
| ANSYS INC                   |         | 16    |
| CENTENE CORP                |         | 118   |
| STARBUCKS CORP              |         | 235   |
| ORACLE CORP                 |         | 391   |
| NETFLIX INC                 |         | 88    |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC     |         | 14    |
| ACTIVISION BLIZZARD INC     |         | 154   |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC      |         | 33    |
| HENRY SCHEIN INC            |         | 25    |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY      |         | 23    |
| POOL CORP                   |         | 8     |
| LAM RESEARCH CORP           |         | 28    |
| COPART INC                  |         | 41    |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC  |         | 15    |
| WYNN RESORTS LTD            |         | 20    |
| COMCAST CORP-CLASS A        |         | 913   |
| XILINX INC                  |         | 49    |
| PACCAR INC                  |         | 72    |
| DENTSPLY SIRONA INC         |         | 45    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     |
|------------------------------|---------|-----|
|                              | 株       | 数   |
| (アメリカ)                       |         | 百株  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         |         | 14  |
| GILEAD SCIENCES INC          |         | 249 |
| CITRIX SYSTEMS INC           |         | 24  |
| INTUITIVE SURGICAL INC       |         | 23  |
| INTUIT INC                   |         | 52  |
| SVB FINANCIAL GROUP          |         | 10  |
| PAYCHEX INC                  |         | 65  |
| ON SEMICONDUCTOR             |         | 77  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    |         | 21  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    |         | 18  |
| AUTODESK INC                 |         | 43  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         |         | 37  |
| SALESFORCE.COM INC           |         | 182 |
| ALPHABET INC-CL A            |         | 60  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A |         | 10  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     |         | 7   |
| GARMIN LTD                   |         | 27  |
| TRIMBLE INC                  |         | 47  |
| QUALCOMM INC                 |         | 226 |
| HOLOGIC INC                  |         | 51  |
| SYNOPSYS INC                 |         | 31  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    |         | 55  |
| AMAZON.COM INC               |         | 85  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       |         | 44  |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        |         | 28  |
| KLA CORP                     |         | 30  |
| STEEL DYNAMICS INC           |         | 43  |
| CERNER CORP                  |         | 64  |
| VERISIGN INC                 |         | 20  |
| WASTE CONNECTIONS INC        |         | 53  |
| EBAY INC                     |         | 134 |
| NVIDIA CORP                  |         | 123 |
| DOLLAR TREE INC              |         | 45  |
| BOOKING HOLDINGS INC         |         | 8   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  |         | 274 |
| TRUIST FINANCIAL CORP        |         | 268 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP |         | 163 |
| BORGWARNER INC               |         | 50  |
| JM SMUCKER CO/THE            |         | 23  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       |         | 31  |
| ASSURANT INC                 |         | 13  |
| AMEREN CORPORATION           |         | 46  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      |         | 99  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    |         | 107 |
| HESS CORP                    |         | 58  |
| JUNIPER NETWORKS INC         |         | 73  |
| F5 INC                       |         | 12  |
| DISH NETWORK CORP-A          |         | 44  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      |         | 34  |
| PLUG POWER INC               |         | 98  |
| NETAPP INC                   |         | 45  |
| INCYTE CORP                  |         | 33  |
| BIOGEN INC                   |         | 30  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |    |
|------------------------------|---------|----|
|                              | 株       | 数  |
| (アメリカ)                       |         | 百株 |
| ILLUMINA INC                 | 29      |    |
| ADOBE INC                    | 96      |    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 51      |    |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 224     |    |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 104     |    |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 34      |    |
| FASTENAL CO                  | 110     |    |
| FISERV INC                   | 114     |    |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 207     |    |
| APPLE INC                    | 3,401   |    |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 30      |    |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 212     |    |
| COSTAR GROUP INC             | 8       |    |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 44      |    |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 27      |    |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       | 189     |    |
| ONEOK INC                    | 91      |    |
| BUNGE LTD                    | 28      |    |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 13      |    |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 33      |    |
| NVR INC                      | 0.73    |    |
| COOPER COS INC/THE           | 11      |    |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 118     |    |
| WR BERKLEY CORP              | 26      |    |
| DISCOVERY INC - A            | 38      |    |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 81      |    |
| EXPEDIA GROUP INC            | 27      |    |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 44      |    |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 65      |    |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 23      |    |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 55      |    |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 112     |    |
| NASDAQ INC                   | 21      |    |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 32      |    |
| AUTOLIV INC                  | 17      |    |
| CBRE GROUP INC - A           | 68      |    |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 5       |    |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 59      |    |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 9       |    |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 13      |    |
| BROWN & BROWN INC            | 49      |    |
| CUMMINS INC                  | 29      |    |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 26      |    |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 12      |    |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 46      |    |
| MASTERCARD INC - A           | 178     |    |
| WESTERN UNION CO             | 81      |    |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 28      |    |
| IPG PHOTONICS CORP           | 7       |    |
| MOSAIC CO/THE                | 72      |    |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 47      |    |
| HEICO CORP                   | 7       |    |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 10      |    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |    |
|------------------------------|---------|----|
|                              | 株       | 数  |
| (アメリカ)                       |         | 百株 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 23      |    |
| INSULET CORP                 | 13      |    |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 24      |    |
| BLACKSTONE INC               | 134     |    |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 65      |    |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 59      |    |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 25      |    |
| MERCADOLIBRE INC             | 8       |    |
| VMWARE INC-CLASS A           | 17      |    |
| LOEWS CORP                   | 45      |    |
| SEAGEN INC                   | 25      |    |
| MASIMO CORP                  | 10      |    |
| ULTA BEAUTY INC              | 10      |    |
| LKQ CORP                     | 57      |    |
| HORMEL FOODS CORP            | 59      |    |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 50      |    |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 27      |    |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 41      |    |
| HUMANA INC                   | 26      |    |
| NRG ENERGY INC               | 51      |    |
| INVESCO LTD                  | 83      |    |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 38      |    |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 21      |    |
| MSCI INC                     | 16      |    |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 38      |    |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 311     |    |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 338     |    |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 113     |    |
| COTERRA ENERGY INC           | 81      |    |
| T-MOBILE US INC              | 112     |    |
| DISCOVERY INC-C              | 58      |    |
| RESMED INC                   | 27      |    |
| GARTNER INC                  | 18      |    |
| AMETEK INC                   | 47      |    |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 82      |    |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 47      |    |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 17      |    |
| FMC CORP                     | 27      |    |
| WABTEC CORP                  | 37      |    |
| EVERSOURCE ENERGY            | 67      |    |
| CROWN HOLDINGS INC           | 28      |    |
| DELTA AIR LINES INC          | 31      |    |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 37      |    |
| VERISK ANALYTICS INC         | 32      |    |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 49      |    |
| FORTINET INC                 | 26      |    |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 4       |    |
| GENERAL MOTORS CO            | 257     |    |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 55      |    |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 55      |    |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 8       |    |
| NORDSON CORP                 | 11      |    |
| HCA HEALTHCARE INC           | 53      |    |

| 銘柄                            | 期首(前期末) |    |
|-------------------------------|---------|----|
|                               | 株       | 数  |
| (アメリカ)                        |         | 百株 |
| MARATHON PETROLEUM CORP       | 133     |    |
| ZILLOW GROUP INC - A          | 12      |    |
| ATMOS ENERGY CORP             | 25      |    |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI  | 25      |    |
| DEXCOM INC                    | 19      |    |
| XYLEM INC                     | 37      |    |
| ABIOMED INC                   | 9       |    |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC      | 9       |    |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA        | 34      |    |
| ALLEGHANY CORP                | 2       |    |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 21      |    |
| PHILLIPS 66                   | 83      |    |
| META PLATFORMS INC-CLASS A    | 480     |    |
| CMS ENERGY CORP               | 60      |    |
| ALBEMARLE CORP                | 23      |    |
| KINDER MORGAN INC             | 397     |    |
| APTIV PLC                     | 52      |    |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING  | 31      |    |
| SPLUNK INC                    | 32      |    |
| HEICO CORP-CLASS A            | 16      |    |
| OGE ENERGY CORP               | 45      |    |
| ABBVIE INC                    | 352     |    |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC     | 9       |    |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC      | 17      |    |
| TESLA INC                     | 151     |    |
| CHENIERE ENERGY INC           | 47      |    |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 25      |    |
| ZOETIS INC                    | 95      |    |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES  | 14      |    |
| NEWS CORP - CLASS A           | 81      |    |
| SNAP-ON INC                   | 9       |    |
| PERKINELMER INC               | 22      |    |
| TWITTER INC                   | 159     |    |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 16      |    |
| WORKDAY INC-CLASS A           | 35      |    |
| SERVICENOW INC                | 39      |    |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B   | 15      |    |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC     | 17      |    |
| ALLEGION PLC                  | 19      |    |
| ALPHABET INC-CL C             | 59      |    |
| UNITED RENTALS INC            | 14      |    |
| VOYA FINANCIAL INC            | 26      |    |
| IQVIA HOLDINGS INC            | 37      |    |
| ALLY FINANCIAL INC            | 71      |    |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  | 55      |    |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN      | 38      |    |
| LIBERTY BROADBAND-C           | 30      |    |
| LIBERTY BROADBAND-A           | 5       |    |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 22      |    |
| OWENS CORNING                 | 22      |    |
| PALO ALTO NETWORKS INC        | 18      |    |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 108     |    |
| QORVO INC                     | 22      |    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |    |
|------------------------------|---------|----|
|                              | 株       | 数  |
| (アメリカ)                       |         | 百株 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 30      |    |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 40      |    |
| ARAMARK                      | 41      |    |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 89      |    |
| LEAR CORP                    | 12      |    |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 24      |    |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 42      |    |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 8       |    |
| WESTROCK CO                  | 51      |    |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 136     |    |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 222     |    |
| EPAM SYSTEMS INC             | 11      |    |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 10      |    |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 29      |    |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 44      |    |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 243     |    |
| AMERCO                       | 1       |    |
| CDW CORP/DE                  | 28      |    |
| SOLAREdge TECHNOLOGIES INC   | 10      |    |
| ARISTA NETWORKS INC          | 11      |    |
| COGNEX CORP                  | 35      |    |
| TRANSUNION                   | 39      |    |
| GODADDY INC - CLASS A        | 35      |    |
| ZENDESK INC                  | 24      |    |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 14      |    |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 31      |    |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 21      |    |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 39      |    |
| VAIL RESORTS INC             | 8       |    |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 4       |    |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 7       |    |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 28      |    |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 17      |    |
| SMITH (A. O.) CORP           | 24      |    |
| UGI CORP                     | 40      |    |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 38      |    |
| FORTIVE CORP                 | 57      |    |
| IHS MARKIT LTD               | 75      |    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 47      |    |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       | 18      |    |
| COUPA SOFTWARE INC           | 12      |    |
| HOWMET AEROSPACE INC         | 71      |    |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 29      |    |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 12      |    |
| TELEFLEX INC                 | 8       |    |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 26      |    |
| TWILIO INC - A               | 27      |    |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 20      |    |
| SNAP INC - A                 | 184     |    |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 24      |    |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 13      |    |
| ROLLINS INC                  | 37      |    |
| XPO LOGISTICS INC            | 18      |    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |    |
|------------------------------|---------|----|
|                              | 株       | 数  |
| (アメリカ)                       |         | 百株 |
| FAIR ISAAC CORP              | 5       |    |
| BAKER HUGHES CO              | 137     |    |
| OKTA INC                     | 23      |    |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | 104     |    |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 25      |    |
| BLACK KNIGHT INC             | 28      |    |
| BLOCK INC                    | 76      |    |
| VISTRA CORP                  | 82      |    |
| INGERSOLL-RAND INC           | 74      |    |
| NOVOCURE LTD                 | 18      |    |
| HUBSPOT INC                  | 9       |    |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 8       |    |
| PTC INC                      | 22      |    |
| ZSCALER INC                  | 14      |    |
| BROADCOM INC                 | 80      |    |
| EVERGY INC                   | 42      |    |
| ALTICE USA INC- A            | 45      |    |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 8       |    |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 5       |    |
| DOCUSIGN INC                 | 36      |    |
| TELADOC HEALTH INC           | 22      |    |
| LINDE PLC                    | 105     |    |
| WIX.COM LTD                  | 10      |    |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 81      |    |
| BURLINGTON STORES INC        | 13      |    |
| KKR & CO INC                 | 106     |    |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 89      |    |
| CIGNA CORP                   | 72      |    |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 50      |    |
| MONGODB INC                  | 10      |    |
| FOX CORP - CLASS A           | 59      |    |
| FOX CORP - CLASS B           | 36      |    |
| DOW INC                      | 147     |    |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 38      |    |
| AVALARA INC                  | 17      |    |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 59      |    |
| STERIS PLC                   | 17      |    |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 191     |    |
| CORTEVA INC                  | 144     |    |
| AMCOR PLC                    | 298     |    |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 37      |    |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A | 86      |    |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 19      |    |
| ROKU INC                     | 22      |    |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 28      |    |
| DATADOG INC - CLASS A        | 37      |    |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 101     |    |
| CABLE ONE INC                | 1       |    |
| CARVANA CO                   | 12      |    |
| CHEWY INC - CLASS A          | 16      |    |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A    | 46      |    |
| ETSY INC                     | 26      |    |
| AVANTOR INC                  | 102     |    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |        |
|------------------------------|---------|--------|
|                              | 株       | 数      |
| (アメリカ)                       |         | 百株     |
| MODERNA INC                  | 56      |        |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A     | 13      |        |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | 28      |        |
| DYNATRACE INC                | 35      |        |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 41      |        |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A      | 14      |        |
| RPM INTERNATIONAL INC        | 25      |        |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 298     |        |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 97      |        |
| PPD INC                      | 26      |        |
| GENERAC HOLDINGS INC         | 12      |        |
| AON PLC-CLASS A              | 45      |        |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 80      |        |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 161     |        |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 31      |        |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 33      |        |
| CATALENT INC                 | 35      |        |
| MATCH GROUP INC              | 49      |        |
| IAC/INTERACTIVECORP          | 16      |        |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 4       |        |
| SUNRUN INC                   | 27      |        |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 37      |        |
| VIATRIS INC                  | 260     |        |
| DRAFTKINGS INC - CL A        | 37      |        |
| ENPHASE ENERGY INC           | 23      |        |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 11      |        |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 166     |        |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  | 47      |        |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 185     |        |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 44      |        |
| 小計                           | 株数      | 62,982 |
| 銘柄数                          | 数       | 593    |
| (カナダ)                        |         |        |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 285     |        |
| IMPERIAL OIL LTD             | 42      |        |
| THOMSON REUTERS CORP         | 34      |        |
| TC ENERGY CORP               | 185     |        |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 74      |        |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 121     |        |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 92      |        |
| BARRICK GOLD CORP            | 363     |        |
| BCE INC                      | 26      |        |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC    | 48      |        |
| BANK OF MONTREAL             | 129     |        |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 256     |        |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 242     |        |
| BAUSCH HEALTH COS INC        | 63      |        |
| CAE INC                      | 60      |        |
| CAMECO CORP                  | 69      |        |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 88      |        |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 242     |        |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 142     |        |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 10      |        |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     |
|------------------------------|---------|-----|
|                              | 株       | 数   |
| (カナダ)                        |         | 百株  |
| ENBRIDGE INC                 |         | 404 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  |         | 5   |
| CGI INC                      |         | 43  |
| IGM FINANCIAL INC            |         | 23  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         |         | 31  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      |         | 386 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      |         | 59  |
| NATIONAL BANK OF CANADA      |         | 68  |
| ONEX CORPORATION             |         | 14  |
| POWER CORP OF CANADA         |         | 116 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    |         | 90  |
| SUNCOR ENERGY INC            |         | 294 |
| WESTON (GEORGE) LTD          |         | 16  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD |         | 135 |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       |         | 51  |
| KINROSS GOLD CORP            |         | 214 |
| GREAT-WEST LIFE CO INC       |         | 56  |
| TMX GROUP LTD                |         | 11  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        |         | 42  |
| SAPUTO INC                   |         | 42  |
| BLACKBERRY LTD               |         | 109 |
| TELUS CORP                   |         | 114 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   |         | 122 |
| YAMANA GOLD INC              |         | 229 |
| FORTIS INC                   |         | 98  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  |         | 168 |
| LUNDIN MINING CORP           |         | 118 |
| PAN AMERICAN SILVER CORP     |         | 36  |
| TORONTO-DOMINION BANK        |         | 363 |
| FRANCO-NEVADA CORP           |         | 37  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP |         | 91  |
| EMPIRE CO LTD 'A'            |         | 37  |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     |         | 34  |
| METRO INC/CN                 |         | 51  |
| OPEN TEXT CORP               |         | 55  |
| INTACT FINANCIAL CORP        |         | 30  |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS     |         | 22  |
| CENOVUS ENERGY INC           |         | 233 |
| PEMBINA PIPELINE CORP        |         | 114 |
| DOLLARAMA INC                |         | 60  |
| KEYERA CORP                  |         | 51  |
| ALTAGAS LTD                  |         | 63  |
| ATCO LTD -CLASS I            |         | 14  |
| INTER PIPELINE LTD           |         | 98  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   |         | 4   |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     |         | 58  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    |         | 18  |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    |         | 30  |
| HYDRO ONE LTD                |         | 67  |
| EMERA INC                    |         | 49  |
| SHOPIFY INC - CLASS A        |         | 22  |
| NUTRIEN LTD                  |         | 109 |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       |
|------------------------------|---------|-------|
|                              | 株       | 数     |
| (カナダ)                        |         | 百株    |
| WSP GLOBAL INC               |         | 24    |
| CANOPY GROWTH CORP           |         | 49    |
| IA FINANCIAL CORP INC        |         | 22    |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD       |         | 51    |
| QUEBECOR INC -CL B           |         | 40    |
| B2GOLD CORP                  |         | 238   |
| AIR CANADA                   |         | 30    |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  |         | 106   |
| PARKLAND CORP                |         | 33    |
| SSR MINING INC               |         | 48    |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   |         | 25    |
| FIRSTSERVICE CORP            |         | 8     |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT |         | 40    |
| NORTHLAND POWER INC          |         | 36    |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD      |         | 15    |
| 小計                           | 株数      | 8,143 |
| 銘柄数                          |         | 87    |
| (ユーロ…ドイツ)                    |         |       |
| COMMERZBANK AG               |         | 192   |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  |         | 404   |
| SIEMENS AG-REG               |         | 153   |
| RWE AG                       |         | 132   |
| BASF SE                      |         | 183   |
| VOLKSWAGEN AG                |         | 6     |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES |         | 170   |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF |         | 34    |
| E. ON SE                     |         | 448   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  |         | 66    |
| BAYER AG-REG                 |         | 196   |
| ALLIANZ SE-REG               |         | 82    |
| CONTINENTAL AG               |         | 22    |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     |         | 258   |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   |         | 30    |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       |         | 58    |
| DEUTSCHE POST AG-REG         |         | 197   |
| SAP SE                       |         | 209   |
| DEUTSCHE BOERSE AG           |         | 36    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  |         | 39    |
| ADIDAS AG                    |         | 38    |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      |         | 671   |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   |         | 27    |
| BEIERSDORF AG                |         | 18    |
| HEIDELBERGCEMENT AG          |         | 31    |
| MERCK KGAA                   |         | 24    |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           |         | 36    |
| PUMA SE                      |         | 19    |
| LANXESS AG                   |         | 16    |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       |         | 88    |
| HOCHTIEF AG                  |         | 5     |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           |         | 70    |
| GEA GROUP AG                 |         | 26    |
| SYMRISE AG                   |         | 26    |
| HENKEL AG & CO KGAA          |         | 20    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |        |
|------------------------------|---------|--------|
|                              | 株       | 数      |
| (ユーロ…ドイツ)                    |         | 百株     |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE |         | 27     |
| RATIONAL AG                  |         | 0.99   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF |         | 13     |
| HANNOVER RUECK SE            |         | 11     |
| BRENTAG SE                   |         | 31     |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR   |         | 9      |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF       |         | 14     |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI |         | 140    |
| LEG IMMOBILIEN SE            |         | 13     |
| VONOVIA SE                   |         | 106    |
| EVONIK INDUSTRIES AG         |         | 37     |
| ZALANDO SE                   |         | 31     |
| COVESTRO AG                  |         | 34     |
| UNIPER SE                    |         | 37     |
| KION GROUP AG                |         | 14     |
| MTU AERO ENGINES AG          |         | 11     |
| DELIVERY HERO SE             |         | 24     |
| SCOUT24 SE                   |         | 20     |
| SARTORIUS AG-VORZUG          |         | 7      |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      |         | 53     |
| NEMETSCHKE SE                |         | 13     |
| BECHTLE AG                   |         | 5      |
| KNORR-BREMSE AG              |         | 16     |
| HELLOFRESH SE                |         | 31     |
| TEAMVIEWER AG                |         | 31     |
| SIEMENS ENERGY AG            |         | 84     |
| 小計                           | 株数      | 4,870  |
|                              | 銘柄数     | 61     |
| (ユーロ…イタリア)                   |         |        |
| ASSICURAZIONI GENERALI       |         | 221    |
| INTESA SANPAOLO              |         | 3,246  |
| TELECOM ITALIA SPA           |         | 2,070  |
| ENI SPA                      |         | 506    |
| UNICREDIT SPA                |         | 410    |
| ENEL SPA                     |         | 1,638  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  |         | 22     |
| ATLANTIA SPA                 |         | 90     |
| MEDIOBANCA SPA               |         | 106    |
| SNAM SPA                     |         | 396    |
| TELECOM ITALIA-RSP           |         | 868    |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA |         | 277    |
| PRYSMIAN SPA                 |         | 49     |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL |         | 56     |
| POSTE ITALIANE SPA           |         | 116    |
| FINECOBANK SPA               |         | 121    |
| MONCLER SPA                  |         | 35     |
| DIASORIN SPA                 |         | 6      |
| AMPLIFON SPA                 |         | 23     |
| NEXI SPA                     |         | 89     |
| 小計                           | 株数      | 10,354 |
|                              | 銘柄数     | 20     |
| (ユーロ…フランス)                   |         |        |
| MICHELIN (CGDE)              |         | 33     |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     |
|------------------------------|---------|-----|
|                              | 株       | 数   |
| (ユーロ…フランス)                   |         | 百株  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI |         | 55  |
| AXA SA                       |         | 390 |
| DANONE                       |         | 124 |
| CARREFOUR SA                 |         | 123 |
| VIVENDI SE                   |         | 171 |
| SOCIETE GENERALE SA          |         | 155 |
| AIR LIQUIDE SA               |         | 95  |
| TOTALENERGIES SE             |         | 504 |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    |         | 102 |
| VINCI SA                     |         | 105 |
| SANOFI                       |         | 226 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         |         | 108 |
| L'OREAL                      |         | 50  |
| ACCOR SA                     |         | 36  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        |         | 108 |
| BNP PARIBAS                  |         | 225 |
| ESSILORLUXOTTICA             |         | 57  |
| CAPGEMINI SE                 |         | 33  |
| VALEO                        |         | 40  |
| HERMES INTERNATIONAL         |         | 6   |
| SODEXO SA                    |         | 16  |
| KERING                       |         | 15  |
| DASSAULT SYSTEMES SE         |         | 27  |
| ATOS SE                      |         | 16  |
| ORANGE                       |         | 395 |
| CNP ASSURANCES               |         | 36  |
| SAFRAN SA                    |         | 64  |
| RENAULT SA                   |         | 40  |
| PUBLICIS GROUPE              |         | 44  |
| BOUYGUES SA                  |         | 41  |
| THALES SA                    |         | 21  |
| PERNOD RICARD SA             |         | 43  |
| CREDIT AGRICOLE SA           |         | 216 |
| ENGIE                        |         | 366 |
| ALSTOM                       |         | 52  |
| ARKEMA                       |         | 12  |
| LEGRAND SA                   |         | 51  |
| SCOR SE                      |         | 25  |
| ADP                          |         | 6   |
| EDF                          |         | 125 |
| NATIXIS                      |         | 225 |
| WENDEL                       |         | 6   |
| BUREAU VERITAS SA            |         | 66  |
| EURAZEO SE                   |         | 9   |
| SUEZ                         |         | 71  |
| EIFFAGE                      |         | 14  |
| ILIAD SA                     |         | 3   |
| ORPEA                        |         | 11  |
| BIOMERIEUX                   |         | 7   |
| GETLINK SE                   |         | 85  |
| EDENRED                      |         | 50  |
| REMY COINTREAU               |         | 4   |
| BOLLORE                      |         | 133 |

| 銘柄                           | 株数  | 期首(前期末) |
|------------------------------|-----|---------|
|                              |     | 株数      |
| (ユーロ…フランス)                   |     | 百株      |
| DASSAULT AVIATION SA         |     | 0.63    |
| SEB SA                       |     | 3       |
| IPSEN                        |     | 8       |
| AMUNDI SA                    |     | 9       |
| FAURECIA                     |     | 18      |
| TELEPERFORMANCE              |     | 11      |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        |     | 20      |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     |     | 5       |
| WORLDLINE SA                 |     | 48      |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   |     | 20      |
| 小計                           | 株数  | 5,215   |
|                              | 銘柄数 | 64      |
| (ユーロ…オランダ)                   |     |         |
| QIAGEN N.V.                  |     | 47      |
| CNH INDUSTRIAL NV            |     | 209     |
| STELLANTIS NV                |     | 401     |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     |     | 100     |
| FERRARI NV                   |     | 26      |
| EXOR NV                      |     | 22      |
| AIRBUS SE                    |     | 118     |
| STMICROELECTRONICS NV        |     | 131     |
| WOLTERS KLUWER               |     | 53      |
| KONINKLIJKE KPN NV           |     | 678     |
| AKZO NOBEL N.V.              |     | 37      |
| HEINEKEN NV                  |     | 53      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       |     | 181     |
| AEGON NV                     |     | 358     |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N |     | 221     |
| RANDSTAD NV                  |     | 21      |
| HEINEKEN HOLDING NV          |     | 23      |
| KONINKLIJKE DSM NV           |     | 35      |
| ING GROEP NV                 |     | 779     |
| ASML HOLDING NV              |     | 85      |
| VOPAK                        |     | 15      |
| NN GROUP NV                  |     | 60      |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         |     | 87      |
| ASM INTERNATIONAL NV         |     | 9       |
| ADYEN NV                     |     | 3       |
| JUST EAT TAKEAWAY            |     | 25      |
| PROSUS NV                    |     | 97      |
| JDE PEET'S NV                |     | 12      |
| ARGENX SE                    |     | 9       |
| 小計                           | 株数  | 3,907   |
|                              | 銘柄数 | 29      |
| (ユーロ…スペイン)                   |     |         |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE |     | 49      |
| ENDESA SA                    |     | 72      |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  |     | 45      |
| IBERDROLA SA                 |     | 1,229   |
| TELEFONICA SA                |     | 1,022   |
| BANCO SANTANDER SA           |     | 3,470   |
| REPSOL SA                    |     | 308     |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA |     | 1,366   |

| 銘柄                            | 株数  | 期首(前期末) |
|-------------------------------|-----|---------|
|                               |     | 株数      |
| (ユーロ…スペイン)                    |     | 百株      |
| NATURGY ENERGY GROUP SA       |     | 62      |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL    |     | 217     |
| FERROVIAL SA                  |     | 96      |
| ENAGAS SA                     |     | 48      |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA  |     | 75      |
| CAIXABANK SA                  |     | 941     |
| GRIFOLS SA                    |     | 59      |
| AMADEUS IT GROUP SA           |     | 91      |
| AENA SME SA                   |     | 14      |
| CELLNEX TELECOM SA            |     | 66      |
| 小計                            | 株数  | 9,238   |
|                               | 銘柄数 | 18      |
| (ユーロ…ベルギー)                    |     |         |
| GALAPAGOS NV                  |     | 10      |
| AGEAS                         |     | 36      |
| UCB SA                        |     | 25      |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   |     | 22      |
| UMICORE                       |     | 36      |
| COLRUYT SA                    |     | 12      |
| KBC GROUP NV                  |     | 47      |
| SOLVAY SA                     |     | 14      |
| PROXIMUS                      |     | 37      |
| SOFINA                        |     | 3       |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    |     | 150     |
| ELIA GROUP SA/NV              |     | 7       |
| 小計                            | 株数  | 406     |
|                               | 銘柄数 | 12      |
| (ユーロ…オーストリア)                  |     |         |
| ERSTE GROUP BANK AG           |     | 56      |
| VERBUND AG                    |     | 13      |
| OMV AG                        |     | 29      |
| VOESTALPINE AG                |     | 17      |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL |     | 29      |
| 小計                            | 株数  | 145     |
|                               | 銘柄数 | 5       |
| (ユーロ…ルクセンブルク)                 |     |         |
| AROUNDTOWN SA                 |     | 204     |
| TENARIS SA                    |     | 110     |
| SES                           |     | 81      |
| EUROFINS SCIENTIFIC           |     | 26      |
| ARCELORMITTAL                 |     | 136     |
| 小計                            | 株数  | 559     |
|                               | 銘柄数 | 5       |
| (ユーロ…フィンランド)                  |     |         |
| NOKIA OYJ                     |     | 1,158   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS          |     | 116     |
| UPM-KYMMENE OYJ               |     | 101     |
| FORTUM OYJ                    |     | 92      |
| KESKO OYJ-B SHS               |     | 54      |
| KONE OYJ-B                    |     | 69      |
| SAMPO OYJ-A SHS               |     | 91      |
| WARTSILA OYJ ABP              |     | 68      |
| ELISA OYJ                     |     | 32      |

| 銘柄                           |     | 期首(前期末) |        |
|------------------------------|-----|---------|--------|
|                              |     | 株       | 数      |
| (ユーロ…フィンランド)                 |     |         | 百株     |
| NESTE OYJ                    |     |         | 87     |
| ORION OYJ-CLASS B            |     |         | 18     |
| 小計                           | 株数  |         | 1,890  |
|                              | 銘柄数 |         | 11     |
| (ユーロ…アイルランド)                 |     |         |        |
| KERRY GROUP PLC-A            |     |         | 33     |
| KINGSPAN GROUP PLC           |     |         | 32     |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI |     |         | 31     |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC      |     |         | 49     |
| CRH PLC                      |     |         | 155    |
| 小計                           | 株数  |         | 302    |
|                              | 銘柄数 |         | 5      |
| (ユーロ…ポルトガル)                  |     |         |        |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  |     |         | 564    |
| JERONIMO MARTINS             |     |         | 54     |
| GALP ENERGIA SGPS SA         |     |         | 110    |
| 小計                           | 株数  |         | 730    |
|                              | 銘柄数 |         | 3      |
| ユーロ計                         | 株数  |         | 37,621 |
|                              | 銘柄数 |         | 233    |
| (イギリス)                       |     |         |        |
| BARCLAYS PLC                 |     |         | 3,458  |
| BP PLC                       |     |         | 4,072  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     |     |         | 14,126 |
| ASTRAZENECA PLC              |     |         | 262    |
| SMITHS GROUP PLC             |     |         | 79     |
| NEXT PLC                     |     |         | 28     |
| DIAGEO PLC                   |     |         | 468    |
| BAE SYSTEMS PLC              |     |         | 615    |
| UNILEVER PLC                 |     |         | 526    |
| TESCO PLC                    |     |         | 1,607  |
| RELX PLC                     |     |         | 382    |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  |     |         | 142    |
| HALMA PLC                    |     |         | 76     |
| PRUDENTIAL PLC               |     |         | 518    |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    |     |         | 1,211  |
| SAGE GROUP PLC/THE           |     |         | 218    |
| HSBC HOLDINGS PLC            |     |         | 4,070  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC |     |         | 458    |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   |     |         | 121    |
| SCHRODERS PLC                |     |         | 28     |
| NATWEST GROUP PLC            |     |         | 1,000  |
| BHP GROUP PLC                |     |         | 420    |
| IMPERIAL BRANDS PLC          |     |         | 180    |
| WPP PLC                      |     |         | 256    |
| BT GROUP PLC                 |     |         | 1,875  |
| SSE PLC                      |     |         | 198    |
| STANDARD CHARTERED PLC       |     |         | 570    |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     |     |         | 1,673  |
| COMPASS GROUP PLC            |     |         | 353    |
| KINGFISHER PLC               |     |         | 430    |
| PEARSON PLC                  |     |         | 153    |
| SEVERN TRENT PLC             |     |         | 47     |
| RIO TINTO PLC                |     |         | 224    |

| 銘柄                           |     | 期首(前期末) |        |
|------------------------------|-----|---------|--------|
|                              |     | 株       | 数      |
| (イギリス)                       |     |         | 百株     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          |     |         | 999    |
| 3I GROUP PLC                 |     |         | 201    |
| VODAFONE GROUP PLC           |     |         | 5,287  |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     |     |         | 559    |
| SAINSBURY (J) PLC            |     |         | 313    |
| AVIVA PLC                    |     |         | 744    |
| JOHNSON MATTHEY PLC          |     |         | 34     |
| RENTOKIL INITIAL PLC         |     |         | 378    |
| RSA INSURANCE GROUP LTD      |     |         | 211    |
| WHITBREAD PLC                |     |         | 35     |
| NATIONAL GRID PLC            |     |         | 700    |
| BUNZL PLC                    |     |         | 66     |
| ANGLO AMERICAN PLC           |     |         | 245    |
| INTERTEK GROUP PLC           |     |         | 30     |
| BURBERRY GROUP PLC           |     |         | 79     |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU |     |         | 35     |
| PERSIMMON PLC                |     |         | 65     |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  |     |         | 61     |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  |     |         | 21     |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     |     |         | 188    |
| SMITH & NEPHEW PLC           |     |         | 163    |
| TAYLOR WIMPEY PLC            |     |         | 780    |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  |     |         | 823    |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  |     |         | 742    |
| ABRDN PLC                    |     |         | 438    |
| EXPERIAN PLC                 |     |         | 185    |
| MONDI PLC                    |     |         | 99     |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC |     |         | 76     |
| ANTOFAGASTA PLC              |     |         | 81     |
| ADMIRAL GROUP PLC            |     |         | 42     |
| FRESNILLO PLC                |     |         | 32     |
| ST JAMES'S PLACE PLC         |     |         | 110    |
| GLENCORE PLC                 |     |         | 1,988  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC |     |         | 14     |
| EVRAZ PLC                    |     |         | 117    |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      |     |         | 61     |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      |     |         | 29     |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       |     |         | 917    |
| COCA-COLA HBC AG-DI          |     |         | 39     |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  |     |         | 262    |
| AVEVA GROUP PLC              |     |         | 25     |
| ASHTED GROUP PLC             |     |         | 87     |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    |     |         | 35     |
| OCADO GROUP PLC              |     |         | 90     |
| AUTO TRADER GROUP PLC        |     |         | 221    |
| DCC PLC                      |     |         | 21     |
| ENTAIN PLC                   |     |         | 121    |
| INFORMA PLC                  |     |         | 314    |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   |     |         | 102    |
| FERGUSON PLC                 |     |         | 46     |
| M&G PLC                      |     |         | 539    |
| JD SPORTS FASHION PLC        |     |         | 102    |
| 小計                           | 株数  |         | 58,840 |
|                              | 銘柄数 |         | 85     |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |          |
|------------------------------|---------|----------|
|                              | 株       | 数        |
| (スイス)                        |         | 百株       |
| NESTLE SA-REG                |         | 577      |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG |         | 103      |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   |         | 502      |
| HOLCIM LTD                   |         | 102      |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN |         | 140      |
| GIVAUDAN-REG                 |         | 1        |
| SONOVA HOLDING AG-REG        |         | 11       |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    |         | 30       |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     |         | 2        |
| LONZA GROUP AG-REG           |         | 14       |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      |         | 6        |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  |         | 9        |
| GEBERIT AG-REG               |         | 7        |
| SWISS RE AG                  |         | 59       |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       |         | 6        |
| NOVARTIS AG-REG              |         | 443      |
| ADECCO GROUP AG-REG          |         | 28       |
| SWISSCOM AG-REG              |         | 5        |
| ABB LTD-REG                  |         | 367      |
| CLARIANT AG-REG              |         | 28       |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG   |         | 33       |
| ROCHE HOLDING AG-BR          |         | 6        |
| SGS SA-REG                   |         | 1        |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     |         | 3        |
| TEMENOS AG - REG             |         | 12       |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   |         | 10       |
| BALOISE HOLDING AG - REG     |         | 10       |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    |         | 6        |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  |         | 0. 02    |
| JULIUS BAER GROUP LTD        |         | 47       |
| SIKA AG-REG                  |         | 28       |
| SWISS PRIME SITE-REG         |         | 14       |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   |         | 0. 21    |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    |         | 3        |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       |         | 0. 58    |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG |         | 7        |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    |         | 1        |
| UBS GROUP AG-REG             |         | 731      |
| VIFOR PHARMA AG              |         | 7        |
| ALCON INC                    |         | 96       |
| 小計                           | 株       | 数 3, 471 |
|                              | 銘柄      | 数 40     |
| (スウェーデン)                     |         |          |
| ELECTROLUX AB-B              |         | 51       |
| ERICSSON LM-B SHS            |         | 566      |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         |         | 78       |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A |         | 309      |
| INVESTOR AB-B SHS            |         | 374      |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |         | 322      |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         |         | 133      |
| SKF AB-B SHARES              |         | 76       |
| ASSA ABLOY AB-B              |         | 199      |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    |         | 168      |

| 銘柄                          | 期首(前期末) |          |
|-----------------------------|---------|----------|
|                             | 株       | 数        |
| (スウェーデン)                    |         | 百株       |
| SANDVIK AB                  |         | 231      |
| SWEDBANK AB - A SHARES      |         | 166      |
| SECURITAS AB-B SHS          |         | 73       |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B  |         | 119      |
| SKANSKA AB-B SHS            |         | 68       |
| SWEDISH MATCH AB            |         | 325      |
| TELE2 AB-B SHS              |         | 114      |
| TELIA CO AB                 |         | 485      |
| VOLVO AB-B SHS              |         | 290      |
| ALFA LAVAL AB               |         | 62       |
| LUNDIN ENERGY AB            |         | 29       |
| BOLIDEN AB                  |         | 54       |
| BOLIDEN AB-RED              |         | 54       |
| HUSQVARNA AB-B SHS          |         | 65       |
| HEXAGON AB-B SHS            |         | 389      |
| KINNEVIK AB - B             |         | 48       |
| KINNEVIK AB-B-RED           |         | 48       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS     |         | 25       |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS |         | 18       |
| ICA GRUPPEN AB              |         | 24       |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS    |         | 62       |
| LUNDBERGS AB-B SHS          |         | 12       |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B         |         | 127      |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS     |         | 32       |
| EPIROC AB-B                 |         | 72       |
| EPIROC AB-B RED SHS         |         | 72       |
| EPIROC AB-A                 |         | 131      |
| EPIROC AB-A RED SHS         |         | 131      |
| NORDEA BANK ABP             |         | 663      |
| EQT AB                      |         | 47       |
| EVOLUTION AB                |         | 31       |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS  |         | 35       |
| 小計                          | 株       | 数 6, 397 |
|                             | 銘柄      | 数 42     |
| (ノルウェー)                     |         |          |
| DNB ASA                     |         | 180      |
| NORSK HYDRO ASA             |         | 261      |
| ORKLA ASA                   |         | 145      |
| EQUINOR ASA                 |         | 204      |
| TELENOR ASA                 |         | 142      |
| YARA INTERNATIONAL ASA      |         | 33       |
| MOWI ASA                    |         | 86       |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA   |         | 30       |
| SCHIBSTED ASA-CL A          |         | 11       |
| SCHIBSTED ASA-B SHS         |         | 25       |
| ADEVINTA ASA                |         | 54       |
| 小計                          | 株       | 数 1, 174 |
|                             | 銘柄      | 数 11     |
| (デンマーク)                     |         |          |
| NOVO NORDISK A/S-B          |         | 343      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES      |         | 41       |
| DANSKE BANK A/S             |         | 143      |
| DEMANT A/S                  |         | 26       |

| 銘柄                           | 銘柄  | 期首(前期末) |       |
|------------------------------|-----|---------|-------|
|                              |     | 株       | 数     |
| (デンマーク)                      |     |         | 百株    |
| H LUNDBECK A/S               |     |         | 18    |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      |     |         | 207   |
| GN STORE NORD A/S            |     |         | 26    |
| CARLSBERG AS-B               |     |         | 22    |
| COLOPLAST-B                  |     |         | 24    |
| DSV A/S                      |     |         | 41    |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       |     |         | 1     |
| TRYG A/S                     |     |         | 30    |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A       |     |         | 0.65  |
| PANDORA A/S                  |     |         | 21    |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       |     |         | 20    |
| GENMAB A/S                   |     |         | 12    |
| ORSTED A/S                   |     |         | 38    |
| ROCKWOOL INTL A/S-B SHS      |     |         | 1     |
| AMBU A/S-B                   |     |         | 32    |
| 小計                           | 株数  |         | 1,054 |
|                              | 銘柄数 |         | 19    |
| (オーストラリア)                    |     |         |       |
| BHP GROUP LTD                |     |         | 588   |
| CSL LTD                      |     |         | 90    |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD       |     |         | 200   |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    |     |         | 566   |
| RIO TINTO LTD                |     |         | 76    |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      |     |         | 274   |
| LENLEASE GROUP               |     |         | 144   |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL |     |         | 354   |
| WESTPAC BANKING CORP         |     |         | 720   |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  |     |         | 656   |
| BRAMBLES LTD                 |     |         | 305   |
| QANTAS AIRWAYS LTD           |     |         | 168   |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         |     |         | 251   |
| TELSTRA CORP LTD             |     |         | 888   |
| AMP LTD                      |     |         | 715   |
| TABCORP HOLDINGS LTD         |     |         | 461   |
| COMPUTERSHARE LTD            |     |         | 115   |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       |     |         | 116   |
| MACQUARIE GROUP LTD          |     |         | 70    |
| CIMIC GROUP LTD              |     |         | 19    |
| ASX LTD                      |     |         | 35    |
| COCHLEAR LTD                 |     |         | 12    |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  |     |         | 93    |
| NEWCREST MINING LTD          |     |         | 167   |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    |     |         | 425   |
| ORIGIN ENERGY LTD            |     |         | 383   |
| ORICA LTD                    |     |         | 91    |
| SONIC HEALTHCARE LTD         |     |         | 91    |
| SANTOS LTD                   |     |         | 383   |
| SUNCORP GROUP LTD            |     |         | 249   |
| TRANSURBAN GROUP             |     |         | 565   |
| WESFARMERS LTD               |     |         | 225   |
| BLUESCOPE STEEL LTD          |     |         | 105   |
| SYDNEY AIRPORT               |     |         | 239   |
| AMPOL LTD                    |     |         | 45    |

| 銘柄                           | 銘柄  | 期首(前期末) |        |
|------------------------------|-----|---------|--------|
|                              |     | 株       | 数      |
| (オーストラリア)                    |     |         | 百株     |
| OIL SEARCH LTD               |     |         | 377    |
| AGL ENERGY LTD               |     |         | 140    |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   |     |         | 345    |
| AUSNET SERVICES              |     |         | 321    |
| CROWN RESORTS LTD            |     |         | 83     |
| AURIZON HOLDINGS LTD         |     |         | 432    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    |     |         | 167    |
| APA GROUP                    |     |         | 215    |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       |     |         | 33     |
| SEEK LTD                     |     |         | 62     |
| REA GROUP LTD                |     |         | 9      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         |     |         | 505    |
| SOUTH32 LTD                  |     |         | 970    |
| EVOLUTION MINING LTD         |     |         | 254    |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD |     |         | 31     |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD  |     |         | 235    |
| WASHINGTON H. SOUL PATINSON  |     |         | 27     |
| COLES GROUP LTD              |     |         | 277    |
| WISETECH GLOBAL LTD          |     |         | 32     |
| AFTERPAY LTD                 |     |         | 40     |
| TPG TELECOM LTD              |     |         | 104    |
| XERO LTD                     |     |         | 26     |
| 小計                           | 株数  |         | 14,595 |
|                              | 銘柄数 |         | 57     |
| (ニュージーランド)                   |     |         |        |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        |     |         | 389    |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    |     |         | 203    |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C |     |         | 123    |
| RYMAN HEALTHCARE LTD         |     |         | 58     |
| MERIDIAN ENERGY LTD          |     |         | 265    |
| MERCURY NZ LTD               |     |         | 145    |
| A2 MILK CO LTD               |     |         | 182    |
| 小計                           | 株数  |         | 1,368  |
|                              | 銘柄数 |         | 7      |
| (香港)                         |     |         |        |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     |     |         | 120    |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    |     |         | 516    |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      |     |         | 270    |
| MTR CORP                     |     |         | 310    |
| HONG KONG & CHINA GAS        |     |         | 2,255  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        |     |         | 330    |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    |     |         | 240    |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  |     |         | 240    |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     |     |         | 450    |
| CLP HOLDINGS LTD             |     |         | 350    |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   |     |         | 283    |
| BANK OF EAST ASIA LTD        |     |         | 329    |
| HANG SENG BANK LTD           |     |         | 157    |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY       |     |         | 71     |
| SINO LAND CO                 |     |         | 682    |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L |     |         | 150    |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   |     |         | 745    |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD |     |         | 270    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       |
|------------------------------|---------|-------|
|                              | 株       | 数     |
| (香港)                         |         | 百株    |
| PCCW LTD                     |         | 810   |
| XINYI GLASS HOLDINGS LTD     |         | 320   |
| SANDS CHINA LTD              |         | 476   |
| WYNN MACAU LTD               |         | 316   |
| SJM HOLDINGS LTD             |         | 240   |
| AIA GROUP LTD                |         | 2,414 |
| SWIRE PROPERTIES LTD         |         | 250   |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L |         | 440   |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     |         | 690   |
| WH GROUP LTD                 |         | 1,640 |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        |         | 521   |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  |         | 650   |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT |         | 320   |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT |         | 409   |
| ESR CAYMAN LTD               |         | 350   |
| 小計                           | 株       | 数     |
|                              | 銘柄      | 数     |
| (シンガポール)                     |         |       |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP |         | 680   |
| CAPITALAND LTD               |         | 445   |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        |         | 102   |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       |         | 352   |
| KEPPEL CORP LTD              |         | 235   |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     |         | 235   |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       |
|------------------------------|---------|-------|
|                              | 株       | 数     |
| (シンガポール)                     |         | 百株    |
| VENTURE CORP LTD             |         | 65    |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   |         | 203   |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS |         | 1,629 |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       |         | 308   |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       |         | 187   |
| UOL GROUP LTD                |         | 88    |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     |         | 367   |
| GENTING SINGAPORE LTD        |         | 1,397 |
| 小計                           | 株       | 数     |
|                              | 銘柄      | 数     |
| (イスラエル)                      |         |       |
| ICL GROUP LTD                |         | 141   |
| BANK HAPOLIM BM              |         | 251   |
| NICE LTD                     |         | 13    |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         |         | 297   |
| ELBIT SYSTEMS LTD            |         | 5     |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A       |         | 269   |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     |         | 26    |
| AZRIELI GROUP LTD            |         | 6     |
| 小計                           | 株       | 数     |
|                              | 銘柄      | 数     |
| 合計                           | 株       | 数     |
|                              | 銘柄      | 数     |

## 外国投資信託証券

| 銘                            | 柄 | 期首(前期末) |       |
|------------------------------|---|---------|-------|
|                              |   | 口       | 数     |
| (アメリカ)                       |   |         | 千口    |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    |   |         | 11    |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT |   |         | 2     |
| PROLOGIS INC                 |   |         | 14    |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        |   |         | 1     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     |   |         | 5     |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  |   |         | 3     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     |   |         | 1     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      |   |         | 2     |
| WELLTOWER INC                |   |         | 8     |
| BOSTON PROPERTIES INC        |   |         | 2     |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC |   |         | 11    |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   |   |         | 2     |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   |   |         | 5     |
| REALTY INCOME CORP           |   |         | 7     |
| REGENCY CENTERS CORP         |   |         | 3     |
| SUN COMMUNITIES INC          |   |         | 2     |
| UDR INC                      |   |         | 5     |
| VENTAS INC                   |   |         | 7     |
| WEYERHAEUSER CO              |   |         | 15    |
| AMERICAN TOWER CORP          |   |         | 8     |
| WP CAREY INC                 |   |         | 3     |
| VEREIT INC                   |   |         | 3     |
| DUKE REALTY CORP             |   |         | 7     |
| IRON MOUNTAIN INC            |   |         | 5     |
| EQUINIX INC                  |   |         | 1     |
| CROWN CASTLE INTL CORP       |   |         | 8     |
| EQUITY RESIDENTIAL           |   |         | 7     |
| INVITATION HOMES INC         |   |         | 10    |
| VICI PROPERTIES INC          |   |         | 10    |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      |   |         | 2     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    |   |         | 12    |
| PUBLIC STORAGE               |   |         | 3     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     |   |         | 6     |
| VORNADO REALTY TRUST         |   |         | 2     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    |   |         | 2     |
| 小計                           |   | 口       | 数     |
|                              | 銘 | 柄       | 数     |
| (カナダ)                        |   |         | 35    |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA |   |         | 1     |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  |   |         | 4     |
| 小計                           |   | 口       | 数     |
|                              | 銘 | 柄       | 数     |
| (ユーロ…フランス)                   |   |         | 5     |
| GECINA SA                    |   |         | 2     |
|                              |   |         | 0.715 |

| 銘                            |   | 柄   | 期首(前期末) |
|------------------------------|---|-----|---------|
|                              |   |     | 口 数     |
| (ユーロ…フランス)                   |   |     | 千口      |
| KLEPIERRE                    |   |     | 4       |
| COVIVIO                      |   |     | 1       |
| 小 計                          | 口 | 数   | 6       |
|                              | 銘 | 柄 数 | 3       |
| (ユーロ…オランダ)                   |   |     |         |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    |   |     | 2       |
| 小 計                          | 口 | 数   | 2       |
|                              | 銘 | 柄 数 | 1       |
| ユ ー ロ 計                      | 口 | 数   | 8       |
|                              | 銘 | 柄 数 | 4       |
| (イギリス)                       |   |     |         |
| BRITISH LAND CO PLC          |   |     | 15      |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |   |     | 15      |
| SEGRO PLC                    |   |     | 24      |
| 小 計                          | 口 | 数   | 55      |
|                              | 銘 | 柄 数 | 3       |
| (オーストラリア)                    |   |     |         |
| VICINITY CENTRES             |   |     | 88      |
| SCENTRE GROUP                |   |     | 103     |
| GPT GROUP                    |   |     | 32      |
| MIRVAC GROUP                 |   |     | 68      |
| STOCKLAND                    |   |     | 45      |
| DEXUS                        |   |     | 18      |
| GOODMAN GROUP                |   |     | 31      |
| 小 計                          | 口 | 数   | 388     |
|                              | 銘 | 柄 数 | 7       |
| (香港)                         |   |     |         |
| LINK REIT                    |   |     | 42      |
| 小 計                          | 口 | 数   | 42      |
|                              | 銘 | 柄 数 | 1       |
| (シンガポール)                     |   |     |         |
| SUNTEC REIT                  |   |     | 48      |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST    |   |     | 64      |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   |   |     | 45      |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER |   |     | 86      |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |   |     | 73      |
| 小 計                          | 口 | 数   | 318     |
|                              | 銘 | 柄 数 | 5       |
| 合 計                          | 口 | 数   | 1,034   |
|                              | 銘 | 柄 数 | 57      |

## ○投資信託財産の構成

(2021年12月27日現在)

| 項 目          | 償 還 時     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| コール・ローン等、その他 | 3,970,632 | 100.0 |
| 投資信託財産総額     | 3,970,632 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2021年12月27日現在)

| 項 目             | 償 還 時          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 3,970,632,485  |
| コール・ローン等        | 3,970,632,485  |
| (B) 負債          | 2,005          |
| 未払利息            | 2,005          |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 3,970,630,480  |
| 元本              | 1,023,650,626  |
| 償還差益金           | 2,946,979,854  |
| (D) 受益権総口数      | 1,023,650,626口 |
| 1万口当たり償還価額(C／D) | 38,788円92銭     |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 33,763,246,044円  
期中追加設定元本額 3,416,906,058円  
期中一部解約元本額 36,156,501,476円  
また、1口当たり純資産額は、期末3.878892円です。

## ②期末における元本の内訳（当該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） | 495,661,859円   |
| 三菱ＵＦＪ ブライムバランス（成長型）（確定拠出年金）   | 338,738,630円   |
| 三菱ＵＦＪ ブライムバランス（安定型）（確定拠出年金）   | 189,250,137円   |
| 合計                            | 1,023,650,626円 |

## 【お 知 ら せ】

当該投資信託を投資対象とする全ての投資信託が、当該投資信託を投資対象から除外することとなるため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。

(2021年12月27日)

## ○損益の状況 (2021年5月21日～2021年12月27日)

| 項 目                | 当 期              |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | 779,805,995      |
| 受取配当金              | 772,777,613      |
| 受取利息               | 1,745            |
| その他収益金             | 9,148,661        |
| 支払利息               | △ 2,122,024      |
| (B) 有価証券売買損益       | 14,155,586,710   |
| 売買益                | 16,940,841,891   |
| 売買損                | △ 2,785,255,181  |
| (C) 先物取引等取引損益      | 312,963,260      |
| 取引益                | 343,229,061      |
| 取引損                | △ 30,265,801     |
| (D) 保管費用等          | △ 44,637,170     |
| (E) 当期損益金(A＋B＋C＋D) | 15,203,718,795   |
| (F) 前期繰越損益金        | 81,969,619,907   |
| (G) 追加信託差損益金       | 9,049,561,720    |
| (H) 解約差損益金         | △103,275,920,568 |
| 償還差益金(E＋F＋G＋H)     | 2,946,979,854    |

(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。