

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	2024年5月10日まで（2014年6月27日設定）	
運用方針	ヘッジ付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、日本を除く先進国の株式に実質的な投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）に概ね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。ただし、市況動向等により、一時的に組入比率の調整を行う場合があります。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為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーフンド	ヘッジ付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、日本を除く先進国の株式等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、円ヘッジ・円ベース）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。
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。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）」およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

ヘッジ付先進国株式 インデックスオープン

第8期（決算日：2022年5月12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「ヘッジ付先進国株式インデックスオープン」は、去る5月12日に第8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。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			MSCIコクサイ・インデックス		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率	(配 当 込 み 、 円ヘッジ・円ベース)	期 中 騰 落 率				
	円	円		%		%	%	%	%	百万円
4期(2018年5月14日)	13,486	0		10.2	697.35	10.7	92.3	5.1	2.1	4,781
5期(2019年5月13日)	13,844	0		2.7	717.72	2.9	88.8	6.8	2.3	2,998
6期(2020年5月12日)	13,527	0	△ 2.3		703.98	△ 1.9	88.1	9.9	2.3	2,668
7期(2021年5月12日)	18,910	0		39.8	987.53	40.3	94.5	3.3	2.1	2,579
8期(2022年5月12日)	17,949	0	△ 5.1		939.04	△ 4.9	94.9	3.2	2.3	531

(注) MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)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。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。

○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 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
			(配 当 込 み 、 円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2021年5月12日	円 18,910	% —	987.53	% —	% 94.5	% 3.3	% 2.1
5月末	19,266	1.9	1,006.20	1.9	95.6	3.2	2.2
6月末	19,718	4.3	1,030.25	4.3	92.8	5.0	2.1
7月末	20,180	6.7	1,054.82	6.8	94.4	2.5	2.2
8月末	20,645	9.2	1,079.28	9.3	95.4	2.5	2.2
9月末	19,872	5.1	1,038.75	5.2	96.2	3.0	2.2
10月末	20,900	10.5	1,092.86	10.7	98.7	1.0	2.3
11月末	20,971	10.9	1,097.20	11.1	93.0	4.0	2.2
12月末	21,545	13.9	1,127.48	14.2	95.7	1.9	2.3
2022年1月末	20,032	5.9	1,048.85	6.2	94.7	3.2	2.2
2月末	19,850	5.0	1,039.34	5.2	95.5	2.5	2.2
3月末	20,734	9.6	1,086.40	10.0	91.9	11.5	2.2
4月末	18,995	0.4	994.81	0.7	95.8	6.3	2.5
(期 末) 2022年5月12日	17,949	△ 5.1	939.04	△ 4.9	94.9	3.2	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8期：2021年5月13日～2022年5月12日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第8期首	18,910円
第8期末	17,949円
既払分配金	0円
騰落率	-5.1%

※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5.1%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－4.9%）を0.2%下回りました。

> 基準価額の主な変動要因

下落要因

ベンチマークに概ね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8期：2021年5月13日～2022年5月12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。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ヘッジ付先進国株式インデックスオープン

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。

▶ ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）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

組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行いました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ ヘッジ付先進国株式インデックスオープン

ベンチマークとの乖離は△0.2%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△0.4%程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は0.2%程度でした。

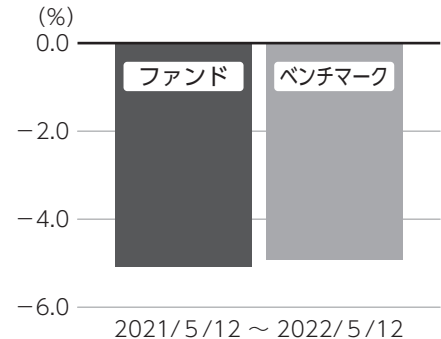
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

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：組入要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）と ベンチマークの対比（騰落率）



▶ 分配金について

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

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第8期 2021年5月13日～2022年5月12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	7,948

(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。)

▶ ヘッジ付先進国株式インデックスオープン

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ ヘッジ付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。
組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

2021年5月13日～2022年5月12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	84	0.418	(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 ）	(67)	(0.330)	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 ）	(11)	(0.055)	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 ）	(7)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)売買委託手数料	1	0.004	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	(1)	(0.003)	
（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	0	0.001	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d)そ の 他 費 用	16	0.077	(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 ）	(14)	(0.068)	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)	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	101	0.500	

期中の平均基準価額は、20,164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。

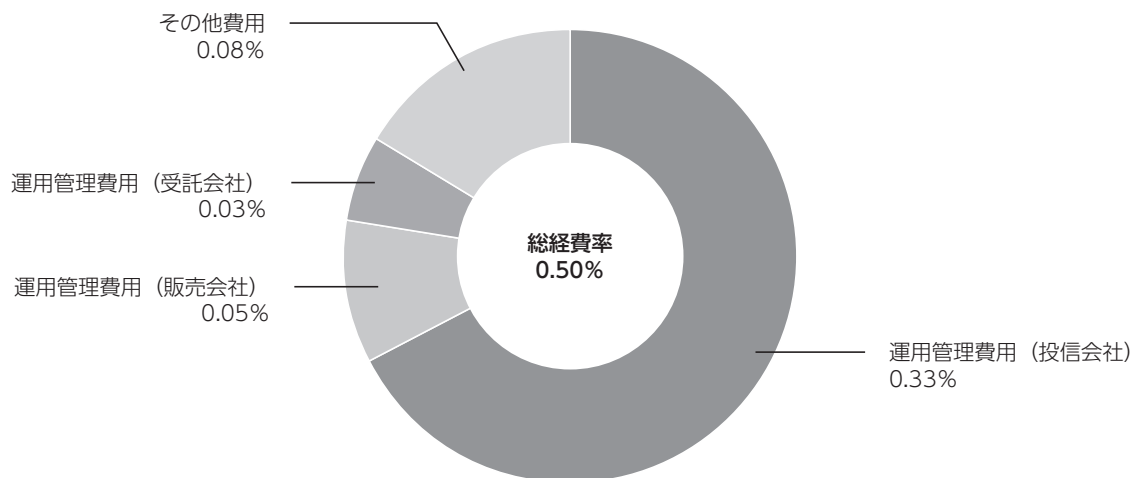
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.50%**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13日～2022年5月12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
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	千口 96,690	千円 253,434	千口 912,374	千円 2,451,995

○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
	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	7,758,942千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	18,658,363千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

(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

<ヘッジ付先進国株式インデックスオープン>

該当事項はありません。

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 241,459	百万円 236,201	% 97.8	百万円 234,475	百万円 228,622	% 97.5
為替直物取引	170	158	92.9	7,396	7,108	96.1

平均保有割合 6.7%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年5月13日～2022年5月12日)

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

○組入資産の明細

(2022年5月12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
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	千口 1,040,391	千口 224,707	千円 530,983

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	千円 530,983	% 99.7
コール・ローン等、その他	1,531	0.3
投資信託財産総額	532,514	100.0

(注) ヘッジ付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（16,008,875千円）の投資信託財産総額（16,346,343千円）に対する比率は97.9%です。

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

1 アメリカドル=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	532,514,461
コール・ローン等	1,490,828
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	530,983,040
未収入金	40,593
(B) 負債	1,436,124
未払信託報酬	1,424,557
その他未払費用	11,567
(C) 純資産総額(A－B)	531,078,337
元本	295,887,585
次期繰越損益金	235,190,752
(D) 受益権総口数	295,887,585口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,949円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,364,175,276円
期中追加設定元本額 143,537,291円
期中一部解約元本額 1,211,824,982円
また、1口当たり純資産額は、期末17,949円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年5月13日～ 2022年5月12日
費用控除後の配当等収益額	3,848,149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	166,561,709円
分配準備積立金額	64,780,894円
当ファンドの分配対象収益額	235,190,752円
1万口当たり収益分配対象額	7,948円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 86
受取利息	1
支払利息	△ 87
(B) 有価証券売買損益	△ 33,463,909
売買益	86,210,186
売買損	△119,674,095
(C) 信託報酬等	△ 5,853,816
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 39,317,811
(E) 前期繰越損益金	64,780,894
(F) 追加信託差損益金	209,727,669
(配当等相当額)	(117,298,831)
(売買損益相当額)	(92,428,838)
(G) 計(D＋E＋F)	235,190,752
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	235,190,752
追加信託差損益金	209,727,669
(配当等相当額)	(117,620,437)
(売買損益相当額)	(92,107,232)
分配準備積立金	68,629,043
繰越損益金	△ 43,165,960

- (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、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。

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

《第15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]

「ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15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15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、円ヘッジ・円ベース）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、円ヘッジ・円ベース）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、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。
主 要 運 用 対 象	MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）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 (配当込み、円ヘッジ・円ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率				
11期(2018年5月14日)	17,459	10.8	697.35	10.7	92.3	5.1	2.1	47,684
12期(2019年5月13日)	17,997	3.1	717.72	2.9	88.9	6.8	2.3	49,740
13期(2020年5月12日)	17,659	△ 1.9	703.98	△ 1.9	88.1	9.9	2.3	52,656
14期(2021年5月12日)	24,790	40.4	987.53	40.3	94.5	3.3	2.1	21,043
15期(2022年5月12日)	23,630	△ 4.7	939.04	△ 4.9	94.9	3.2	2.3	16,192

(注) MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）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。また、MSCI コクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、 円ヘッジ・円ベース)		株 式 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) 2021年5月12日	円	%		%	%	%	%
	24,790	—	987.53	—	94.5	3.3	2.1
5月末	25,263	1.9	1,006.20	1.9	95.6	3.2	2.2
6月末	25,865	4.3	1,030.25	4.3	92.8	5.0	2.1
7月末	26,480	6.8	1,054.82	6.8	94.4	2.5	2.2
8月末	27,100	9.3	1,079.28	9.3	95.4	2.5	2.2
9月末	26,094	5.3	1,038.75	5.2	96.2	3.0	2.2
10月末	27,454	10.7	1,092.86	10.7	98.7	1.0	2.3
11月末	27,557	11.2	1,097.20	11.1	93.0	4.0	2.2
12月末	28,321	14.2	1,127.48	14.2	95.7	1.9	2.3
2022年1月末	26,342	6.3	1,048.85	6.2	94.7	3.2	2.2
2月末	26,112	5.3	1,039.34	5.2	95.5	2.5	2.2
3月末	27,284	10.1	1,086.40	10.0	91.9	11.5	2.2
4月末	25,004	0.9	994.81	0.7	95.8	6.3	2.5
(期 末) 2022年5月12日	23,630	△ 4.7	939.04	△ 4.9	94.9	3.2	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

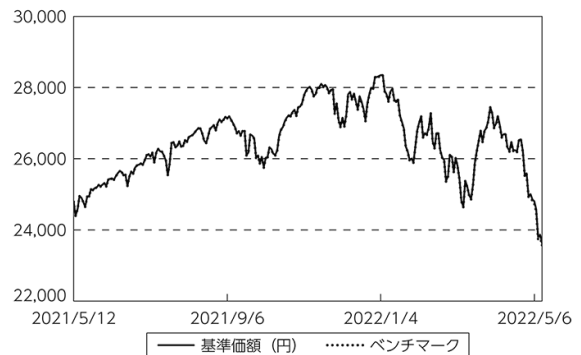
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－4.9%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・外国株式市況は下落しました。
- ・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。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）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

- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行いました。

●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4.9%の下落になったため、乖離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因※によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・組入要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 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	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.005	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(1)	(0.004)	
(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	0	0.001	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	22	0.082	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(20)	(0.076)	
(そ の 他)	(1)	(0.005)	
合 計	23	0.088	
期中の平均基準価額は、26,490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 497 (74)	千アメリカドル 3,491 (398)	百株 3,684 (113)	千アメリカドル 44,179 (656)
	カナダ	82 (18)	千カナダドル 495 (△ 3)	557	千カナダドル 2,953
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	19 (45)	95 (2)	321	1,520
	イタリア	276 (ー)	34 (△0.13934)	701	317
	フランス	46 (53)	95 (ー)	379	1,775
	オランダ	46 (26)	214 (ー)	280 (ー)	1,000 (0.39172)
	スペイン	31 (735)	60 (12)	1,236	417
	ベルギー	3	18	27	155
	オーストリア	2	8	10	39
	ルクセンブルク	10	18	57	75
	フィンランド	3	14	124	195
	アイルランド	ー	ー	17	110
	ポルトガル	7	7	43	28
	イギリス	136 (47)	千イギリスポンド 99 (49)	3,492 (93)	千イギリスポンド 2,187 (40)
	スイス	11 (3)	千スイスフラン 198 (△ 8)	210	千スイスフラン 1,869
	スウェーデン	91 (239)	千スウェーデンクローネ 2,581 (283)	396 (69)	千スウェーデンクローネ 6,917 (457)
	ノルウェー	19	千ノルウェークローネ 205	72	千ノルウェークローネ 1,191
	デンマーク	11	千デンマーククローネ 459	60	千デンマーククローネ 3,692
	オーストラリア	180 (91)	千オーストラリアドル 577 (16)	1,086 (131)	千オーストラリアドル 1,912 (51)
	ニュージーランド	46	千ニュージーランドドル 25	91	千ニュージーランドドル 85

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 266 (18)	千香港ドル 545 (△ 2)	百株 1,369	千香港ドル 4,306
	シンガポール	139 (215)	千シンガポールドル 48 (20)	466 (215)	千シンガポールドル 267 (30)
	イスラエル	28	千イスラエルシェケル 90	79	千イスラエルシェケル 314

(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	—	—	0.49	17
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.039	7	0.183	34
	PROLOGIS INC	—	—	0.794	114
	CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	0.114	18
	DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	0.275	42
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.096	7	0.214	17
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	—	0.073	24
	EXTRA SPACE STORAGE INC	—	—	0.163	29
	WELLTOWER INC	—	—	0.465	39
	BOSTON PROPERTIES INC	0.07	7	0.262	31
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	—	0.655	13
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	0.089	17
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	—	0.825	23
	REALTY INCOME CORP	0.416 (0.55)	28 (35)	0.729	51
	REGENCY CENTERS CORP	—	—	0.281	18
	SUN COMMUNITIES INC	0.041	7	0.149	27
	UDR INC	0.203	9	0.268	14
	VENTAS INC	0.174	9	0.395	21
	WEYERHAEUSER CO	—	—	0.737	27
	AMERICAN TOWER CORP	—	—	0.451	122
	WP CAREY INC	—	—	0.081	6
	VEREIT INC	— (△0.781)	— (△ 35)	—	—
	DUKE REALTY CORP	—	—	0.47	25
	IRON MOUNTAIN INC	—	—	0.289	12
	EQUINIX INC	—	—	0.089	72
	CROWN CASTLE INTL CORP	—	—	0.453	84
	EQUITY RESIDENTIAL	—	—	0.449	37
	INVITATION HOMES INC	0.197	7	0.848	34
	VICI PROPERTIES INC	0.875	26	0.45	13
	SBA COMMUNICATIONS CORP	—	—	0.104	36
	ORION OFFICE REIT INC	— (0.175)	— (—)	0.175	3
	HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	0.899	16
	PUBLIC STORAGE	—	—	0.166	56
	SIMON PROPERTY GROUP INC	—	—	0.303	43
	VORNADO REALTY TRUST	0.392	17	0.389	16
	KIMCO REALTY CORP	1	41	0.173	4
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	—	0.161	37
	小計	4 (△0.056)	171 (—)	13	1,208

	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	—	—	0.2	12
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	—	0.5	10
	小計	—	—	0.7	22
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	—	—	0.062	7
	KLEPIERRE	—	—	0.47	11
		(—)	(△ 0.614)		
	COVIVIO	—	—	0.096	7
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	—	0.163	11
	小計	—	—	0.791	38
		(—)	(△ 0.614)		
	ユーロ計	—	—	0.791	38
		(—)	(△ 0.614)		
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	—	—	2	10
	LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	0.418	3
	SEGRO PLC	—	—	1	19
	小計	—	—	4	33
	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	—	—	7	11
	SCENTRE GROUP	—	—	7	23
	DEXUS/AU	—	—	1	11
		(3)	(37)		
	GPT GROUP	—	—	1	5
	MIRVAC GROUP	—	—	3	11
	STOCKLAND	—	—	2	11
	DEXUS	—	—	—	—
		(△ 3)	(△ 37)		
	GOODMAN GROUP	0.805	15	1	36
	小計	0.805	15	25	111
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	1	74	2	153
	小計	1	74	2	153
	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	—	—	9	13
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	—	—
		(0.079)	(0.09689)		
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	—	8	18
		(—)	(△0.12005)		
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	6	12
		(—)	(△0.02501)		
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	—	—	—	—
		(1)	(2)		

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	—	—	2	7
		(—)	(△0.28732)		
小 計		—	—	26	50
		(1)	(1)		

(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
		8,148	8,439	—	—

(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	7,758,942千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	18,658,363千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

(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 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 241,459	百万円 236,201	% 97.8	百万円 234,475	百万円 228,622	% 97.5
為替直物取引	170	158	92.9	7,396	7,108	96.1

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12日現在)

外国株式

銘柄	株数	当期			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	24	16	265	34,459	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	63	44	472	61,367	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10	7	86	11,257	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15	10	221	28,792	ソフトウェア・サービス
AES CORP	23	16	33	4,354	公益事業
AFLAC INC	23	15	90	11,728	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30	20	123	15,964	保険
ADVANCED MICRO DEVICES	43	41	363	47,154	半導体・半導体製造装置
ACCENTURE PLC-CL A	22	15	448	58,186	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7	5	130	16,894	素材
ANTHEM INC	8	6	299	38,832	ヘルスケア機器・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	50	36	139	18,123	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	18	12	91	11,838	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	19	14	182	23,708	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	10	8	202	26,236	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	8	5	46	6,078	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	82	56	426	55,388	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	5	3	229	29,838	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	148	104	500	64,998	電気通信サービス
BALL CORP	11	8	54	7,133	素材
ALLSTATE CORP	10	7	93	12,077	保険
AVERY DENNISON CORP	2	2	35	4,635	素材
CHUBB LTD	16	10	222	28,918	保険
ANALOG DEVICES INC	13	13	206	26,745	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	0.87	0.53	102	13,280	小売
CVS HEALTH CORP	47	33	327	42,446	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	28	20	71	9,279	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	109	74	882	114,461	銀行
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	1	29	3,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	19	13	280	36,403	資本財
COCA-COLA CO/THE	146	103	667	86,576	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16	10	128	16,698	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	6	4	23	3,067	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	27	55	185	24,096	運輸
CHEVRON CORP	70	48	795	103,198	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	47	33	330	42,837	エネルギー
CME GROUP INC	13	9	180	23,403	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	9	6	37	4,918	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	29	20	155	20,158	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	30	20	170	22,064	公益事業
DEVON ENERGY CORP	23	16	105	13,647	エネルギー
DEERE & CO	10	7	270	35,146	資本財
DANAHER CORP	23	16	385	50,000	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALT DISNEY CO/THE	64	45	483	62,722	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	4	3	40	5,313	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	26	19	213	27,713	公益事業

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DR HORTON INC	12	8	55	7,204	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	18	12	258	33,522	小売
DAVITA INC	3	1	17	2,268	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	4	3	47	6,178	資本財
DTE ENERGY COMPANY	7	4	63	8,290	公益事業
EXXON MOBIL CORP	150	107	928	120,545	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	22	15	147	19,135	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	21	14	179	23,279	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	21	15	125	16,224	資本財
EXELON CORP	35	24	117	15,276	公益事業
ECOLAB INC	9	6	104	13,558	素材
EQUIFAX INC	4	3	59	7,681	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8	5	134	17,421	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	14	10	141	18,400	資本財
EDISON INTERNATIONAL	12	9	65	8,559	公益事業
ENTERGY CORP	7	5	59	7,729	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	1	1	27	3,614	保険
NEXTERA ENERGY INC	70	49	347	45,157	公益事業
FEDEX CORP	9	6	131	17,127	運輸
FORD MOTOR CO	139	99	127	16,517	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	7	8	19	2,510	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1	0.93	34	4,414	各種金融
FIRSTENERGY CORP	21	13	57	7,514	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	54	37	133	17,307	素材
GENERAL MILLS INC	23	15	109	14,274	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	8	6	136	17,670	資本財
WW GRAINGER INC	1	1	52	6,852	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	317	27	201	26,095	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	10	7	85	11,152	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	5	3	46	5,988	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11	8	256	33,262	各種金融
HALLIBURTON CO	28	22	78	10,218	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25	17	333	43,308	資本財
HP INC	51	29	104	13,537	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12	8	60	7,789	保険
HERSHEY CO/THE	5	3	82	10,727	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	38	26	747	96,940	小売
HASBRO INC	5	3	29	3,785	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8	5	78	10,179	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	32	22	296	38,431	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	14	9	46	5,975	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	11	7	161	21,002	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	14	9	30	3,989	メディア・娯楽
IDEX CORP	2	2	36	4,761	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7	6	82	10,713	素材
JOHNSON & JOHNSON	94	66	1,171	152,063	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	3	—	—	—	運輸
KELLOGG CO	10	6	48	6,349	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	12	8	118	15,340	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	52	35	230	29,972	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	28	17	96	12,584	食品・生活必需品小売り
ELI LILLY & CO	30	20	589	76,453	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		3	2	57	7,492	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		4	3	15	2,065	運輸
LENNAR CORP-A		9	6	48	6,356	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC		26	17	319	41,496	小売
BATH & BODY WORKS INC		—	6	30	3,973	小売
LAS VEGAS SANDS CORP		12	9	28	3,660	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP		9	6	276	35,834	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP		7	4	24	3,235	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC		1	0.83	17	2,256	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		9	7	117	15,231	消費者サービス
MCDONALD'S CORP		26	18	461	59,950	消費者サービス
S&P GLOBAL INC		8	8	291	37,840	各種金融
MEDTRONIC PLC		48	33	342	44,382	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.		90	63	569	73,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC		40	28	189	24,556	半導体・半導体製造装置
3M CO		20	14	213	27,644	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC		5	4	86	11,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL		16	9	33	4,287	消費者サービス
MASCO CORP		8	6	31	4,076	資本財
M & T BANK CORP		4	4	74	9,673	銀行
MARSH & MCLENNAN COS		18	12	199	25,903	保険
MOLINA HEALTHCARE INC		2	1	42	5,541	ヘルスケア機器・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		2	1	19	2,578	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY		50	33	267	34,776	各種金融
MCKESSON CORP		5	3	128	16,634	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC		28	18	115	15,002	保険
MOODY'S CORP		6	4	119	15,489	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP		9	6	151	19,644	運輸
BANK OF AMERICA CORP		279	186	661	85,902	銀行
NISOURCE INC		13	10	29	3,861	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP		5	3	170	22,075	資本財
NEWMONT CORP		30	20	137	17,837	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		9	6	61	7,959	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP		0.53	0.34	43	5,661	保険
NUCOR CORP		10	7	90	11,786	素材
NEWELL BRANDS INC		14	9	20	2,618	耐久消費財・アパレル
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		31	23	142	18,429	エネルギー
OMNICOM GROUP		8	5	39	5,161	メディア・娯楽
PEPSICO INC		49	34	596	77,380	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA		2	2	37	4,926	素材
ALTRIA GROUP INC		67	46	239	31,144	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL		4	—	—	—	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE		89	61	933	121,142	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		15	10	170	22,130	銀行
PFIZER INC		198	141	701	91,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		14	9	98	12,744	保険
PULTEGROUP INC		8	6	27	3,604	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP		4	3	86	11,171	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		6	5	146	18,990	エネルギー
CITIGROUP INC		75	50	238	30,967	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		9	6	45	5,865	保険
PPG INDUSTRIES INC		8	6	74	9,678	素材

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
PENTAIR PLC	6	4	20	2,615	資本財	
P G & E CORP	59	37	45	5,876	公益事業	
PPL CORP	28	19	54	7,035	公益事業	
PROGRESSIVE CORP	20	14	159	20,717	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	17	12	88	11,488	公益事業	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8	5	34	4,534	消費者サービス	
REPUBLIC SERVICES INC	8	5	72	9,435	商業・専門サービス	
REGIONS FINANCIAL CORP	33	23	47	6,224	銀行	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1	—	—	—	保険	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3	2	114	14,877	ソフトウェア・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	20	15	48	6,280	公益事業	
ROBERT HALF INTL INC	4	2	26	3,449	商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3	2	58	7,566	資本財	
SCHLUMBERGER LTD	49	35	136	17,671	エネルギー	
STRYKER CORP	12	8	194	25,243	ヘルスケア機器・サービス	
SCHWAB (CHARLES) CORP	55	36	238	30,946	各種金融	
SEMPRA ENERGY	10	8	128	16,673	公益事業	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8	6	166	21,603	素材	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5	4	49	6,362	資本財	
TRAVELERS COS INC/THE	9	6	107	13,913	保険	
SOUTHERN CO/THE	37	26	197	25,690	公益事業	
AT&T INC	255	180	350	45,491	電気通信サービス	
WESTERN DIGITAL CORP	11	7	41	5,397	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STATE STREET CORP	12	9	61	7,942	各種金融	
SYSCO CORP	17	12	109	14,148	食品・生活必需品小売り	
SEALED AIR CORP	4	3	23	3,074	素材	
TEXAS INSTRUMENTS INC	32	23	384	49,881	半導体・半導体製造装置	
TERADYNE INC	5	4	41	5,395	半導体・半導体製造装置	
GLOBE LIFE INC	3	2	23	3,089	保険	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	25	17	90	11,754	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14	9	517	67,210	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TEXTRON INC	8	5	34	4,434	資本財	
UNION PACIFIC CORP	24	16	363	47,181	運輸	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	54	37	344	44,697	資本財	
UNITEDHEALTH GROUP INC	34	23	1,158	150,274	ヘルスケア機器・サービス	
US BANCORP	48	35	172	22,368	銀行	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	26	18	327	42,442	運輸	
VALERO ENERGY CORP	14	10	124	16,158	エネルギー	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	20	15	40	5,302	メディア・娯楽	
VF CORP	11	8	37	4,899	耐久消費財・アパレル	
VULCAN MATERIALS CO	4	3	52	6,873	素材	
WILLIAMS COS INC	44	30	105	13,755	エネルギー	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27	18	80	10,446	食品・生活必需品小売り	
WEC ENERGY GROUP INC	11	7	81	10,536	公益事業	
WALMART INC	50	38	572	74,251	食品・生活必需品小売り	
WELLS FARGO & CO	140	100	429	55,673	銀行	
WASTE MANAGEMENT INC	15	10	166	21,642	商業・専門サービス	
WATERS CORP	2	1	47	6,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WHIRLPOOL CORP	2	1	28	3,688	耐久消費財・アパレル	
XCEL ENERGY INC	18	13	100	13,045	公益事業	
KEYCORP	33	23	43	5,656	銀行	
CARMAX INC	5	4	36	4,777	小売	

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		7	5	59	7,786	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC		10	7	80	10,457	消費者サービス
TJX COMPANIES INC		43	30	167	21,700	小売
CLOROX COMPANY		4	3	49	6,470	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP		4	2	38	5,050	素材
CADENCE DESIGN SYS INC		10	6	94	12,307	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP		23	20	28	3,671	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		22	15	143	18,663	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC		15	12	43	5,668	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC		12	8	84	10,974	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP		24	17	61	8,032	銀行
INTEL CORP		147	102	440	57,125	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC		151	106	518	67,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP		3	2	87	11,312	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP		15	11	546	70,893	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC		33	22	237	30,787	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC		10	7	85	11,148	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A		9	7	67	8,720	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC		21	14	35	4,648	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC		12	8	78	10,237	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		9	14	90	11,754	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B		45	32	348	45,235	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP		5	4	22	2,858	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC		21	14	342	44,437	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHERN TRUST CORP		6	4	50	6,597	各種金融
MICROSOFT CORP		258	180	4,697	609,622	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC		3	2	52	6,816	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP		20	14	119	15,479	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP		42	29	207	26,947	消費者サービス
ORACLE CORP		70	41	294	38,197	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC		15	11	186	24,159	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		2	1	103	13,402	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC		27	19	152	19,774	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC		5	4	41	5,387	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC		5	3	29	3,872	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY		3	2	55	7,159	小売
POOL CORP		1	1	40	5,246	小売
LAM RESEARCH CORP		5	3	159	20,659	半導体・半導体製造装置
COPART INC		7	5	57	7,496	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		2	2	19	2,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD		3	2	15	2,039	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A		163	115	458	59,507	メディア・娯楽
XILINX INC		9	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC		12	8	72	9,423	資本財
DENTSPLY SIRONA INC		8	5	20	2,708	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC		2	1	48	6,281	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC		45	31	191	24,896	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC		4	3	31	4,078	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		4	9	190	24,710	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC		9	6	241	31,383	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP		1	1	65	8,476	銀行
PAYCHEX INC		11	8	97	12,595	ソフトウェア・サービス

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ON SEMICONDUCTOR	14	10	56	7,329	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	—	1	29	3,861	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3	2	32	4,189	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3	2	66	8,680	運輸
AUTODESK INC	7	5	100	13,012	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6	3	7	970	電気通信サービス
SALESFORCE INC	32	24	398	51,775	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	10	7	1,726	224,081	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1	1	42	5,509	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1	0.96	24	3,151	各種金融
GARMIN LTD	5	3	37	4,855	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	9	6	38	4,998	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	41	28	374	48,604	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	8	6	46	6,065	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	5	3	100	13,031	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	15	11	2,431	315,598	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	8	5	64	8,415	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	5	3	41	5,344	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	5	3	119	15,529	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	7	5	39	5,076	素材
CERNER CORP	11	7	69	9,074	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	3	2	42	5,502	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	9	6	81	10,522	商業・専門サービス
EBAY INC	25	15	73	9,550	小売
NVIDIA CORP	22	63	1,051	136,411	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	8	5	88	11,524	小売
BOOKING HOLDINGS INC	1	1	215	27,965	消費者サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	49	32	1,026	133,212	各種金融
TRUIST FINANCIAL CORP	48	33	158	20,512	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30	19	84	10,907	各種金融
BORGWARNER INC	9	5	20	2,684	自動車・自動車部品
JM SMUCKER CO/THE	3	2	39	5,154	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	4	3	62	8,142	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	2	1	26	3,490	保険
AMEREN CORPORATION	7	6	61	7,940	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	17	12	126	16,457	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	19	14	119	15,490	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	9	7	78	10,134	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	11	8	25	3,284	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	2	1	25	3,320	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	8	6	11	1,459	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5	4	40	5,232	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	17	12	17	2,241	資本財
NETAPP INC	7	5	39	5,122	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	6	4	35	4,594	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENTEGRIS INC	—	3	34	4,531	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	5	3	70	9,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	5	3	79	10,367	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	17	12	455	59,169	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9	6	151	19,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43	27	20	2,668	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

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	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	18	13	96	12,464	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	6	4	46	6,011	運輸
FASTENAL CO	21	14	73	9,576	資本財
FISERV INC	20	15	138	18,033	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38	24	14	1,880	メディア・娯楽
APPLE INC	611	414	6,076	788,531	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6	3	48	6,285	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	41	35	45	5,933	銀行
COSTAR GROUP INC	1	10	54	7,032	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7	—	—	—	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	5	3	37	4,861	運輸
LUMEN TECHNOLOGIES INC	35	22	23	3,037	電気通信サービス
ONEOK INC	15	11	69	9,059	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	5	3	39	5,071	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	2	1	29	3,887	小売
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6	4	102	13,246	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.12	0.08	32	4,267	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	1	1	38	5,004	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	21	15	103	13,450	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	5	5	36	4,679	保険
DISCOVERY INC - A	4	—	—	—	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	14	10	85	11,062	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	5	3	49	6,396	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7	5	52	6,748	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	11	9	20	2,704	電気通信サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4	2	72	9,350	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10	6	25	3,308	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	20	14	134	17,459	各種金融
NASDAQ INC	3	2	41	5,408	各種金融
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6	4	36	4,781	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	2	—	—	—	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	11	8	66	8,583	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.94	0.71	90	11,809	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10	7	50	6,509	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1	1	42	5,570	半導体・半導体製造装置
ARROW ELECTRONICS INC	2	1	21	2,815	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	9	5	32	4,250	保険
CUMMINS INC	5	3	70	9,190	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5	3	42	5,530	商業・専門サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2	1	50	6,551	素材
ALLIANT ENERGY CORP	7	6	37	4,811	公益事業
MASTERCARD INC - A	31	22	722	93,752	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	15	9	14	1,945	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	5	3	35	4,583	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	3	15	1,979	資本財
IPG PHOTONICS CORP	1	0.95	8	1,163	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	11	9	55	7,253	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	10	3	1	180	消費者サービス
HEICO CORP	2	1	15	2,037	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	1	1	75	9,851	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3	2	39	5,147	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	
INSULET CORP		2	1	32	4,233	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		4	3	63	8,242	保険
BLACKSTONE INC		24	17	167	21,784	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD		11	8	100	13,063	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		10	7	77	10,101	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC		4	2	87	11,302	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC		1	1	78	10,143	小売
VMWARE INC-CLASS A		3	5	52	6,751	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP		8	5	31	4,047	保険
SEAGEN INC		4	3	40	5,285	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MASIMO CORP		1	1	16	2,134	ヘルスケア機器・サービス
ULTA BEAUTY INC		1	1	49	6,391	小売
LKQ CORP		11	6	32	4,235	小売
HORMEL FOODS CORP		11	7	38	5,060	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC		9	5	25	3,274	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO		4	3	34	4,507	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		7	4	118	15,380	資本財
HUMANA INC		4	3	140	18,208	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC		8	5	24	3,172	公益事業
INVESCO LTD		10	8	14	1,910	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		7	4	36	4,792	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY		4	2	15	2,017	各種金融
MSCI INC		2	2	80	10,456	各種金融
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B		7	4	26	3,411	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		55	39	407	52,913	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES		60	42	830	107,729	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC		19	18	67	8,740	食品・飲料・タバコ
COTERRA ENERGY INC		18	19	57	7,512	エネルギー
T-MOBILE US INC		20	15	194	25,260	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C		11	—	—	—	メディア・娯楽
RESMED INC		5	3	70	9,168	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC		3	2	50	6,606	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC		8	5	70	9,174	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD		15	9	44	5,821	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC		8	6	60	7,846	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		2	2	35	4,665	運輸
FMC CORP		5	3	38	5,036	素材
WABTEC CORP		7	4	38	4,941	資本財
EVERSOURCE ENERGY		11	8	77	10,069	公益事業
CROWN HOLDINGS INC		5	3	32	4,165	素材
DELTA AIR LINES INC		4	4	18	2,340	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC		5	4	65	8,560	公益事業
VERISK ANALYTICS INC		5	3	67	8,758	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP		8	5	134	17,484	小売
FORTINET INC		5	3	91	11,886	ソフトウェア・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		0.81	0.58	68	8,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO		46	33	123	15,965	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV		9	6	114	14,900	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A		9	6	71	9,337	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		1	1	20	2,673	資本財
NORDSON CORP		2	1	27	3,588	資本財
HCA HEALTHCARE INC		10	6	131	17,102	ヘルスケア機器・サービス

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
MARATHON PETROLEUM CORP		24	15	143	18,568	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A		1	1	4	565	不動産
ATMOS ENERGY CORP		4	3	36	4,793	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		5	3	24	3,152	資本財
DEXCOM INC		3	2	77	10,013	ヘルスケア機器・サービス
XYLEM INC		5	4	36	4,723	資本財
ABIOMED INC		1	1	25	3,332	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		2	1	22	2,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		6	4	62	8,057	銀行
ALLEGHANY CORP		0.53	0.35	29	3,772	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS		3	2	163	21,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66		16	12	110	14,355	エネルギー
META PLATFORMS INC-CLASS A		86	59	1,129	146,515	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP		9	7	51	6,683	公益事業
ALBEMARLE CORP		4	2	63	8,182	素材
KINDER MORGAN INC		68	51	95	12,398	エネルギー
APTIV PLC		9	6	62	8,077	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		5	4	17	2,259	資本財
SPLUNK INC		5	4	35	4,668	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A		2	1	20	2,666	資本財
OGE ENERGY CORP		5	—	—	—	公益事業
ABBVIE INC		63	44	679	88,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		1	1	45	5,948	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAREPTA THERAPEUTICS INC		2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC		27	21	1,583	205,552	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC		7	6	81	10,514	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		4	4	43	5,633	各種金融
ZOETIS INC		17	11	191	24,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		2	1	54	7,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A		10	9	16	2,122	メディア・娯楽
SNAP-ON INC		1	1	28	3,694	資本財
PERKINELMER INC		4	2	40	5,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP		—	0.99	33	4,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TWITTER INC		28	20	93	12,087	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		3	1	33	4,370	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		6	4	84	10,942	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC		6	5	211	27,384	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		3	1	22	2,941	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		3	1	44	5,749	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC		3	2	24	3,185	資本財
ALPHABET INC-CL C		10	7	1,647	213,844	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC		2	1	51	6,632	資本財
VOYA FINANCIAL INC		4	—	—	—	各種金融
IQVIA HOLDINGS INC		6	4	96	12,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC		15	9	37	4,878	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		9	7	95	12,358	消費者サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		—	4	54	7,071	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN		6	4	60	7,906	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C		5	3	39	5,099	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-A		1	0.66	7	915	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		3	2	30	3,974	メディア・娯楽
OWENS CORNING		3	2	22	2,962	資本財

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
PALO ALTO NETWORKS INC	3	2	116	15,079	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	17	13	49	6,359	各種金融
QORVO INC	3	2	27	3,600	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6	5	82	10,749	保険
ARAMARK	8	5	19	2,548	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14	12	48	6,238	銀行
LEAR CORP	2	1	19	2,468	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4	3	36	4,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9	—	—	—	素材
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1	1	12	1,573	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	10	6	33	4,330	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	23	17	74	9,613	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	39	28	211	27,498	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	1	1	42	5,494	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	1	1	34	4,455	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	5	4	16	2,181	不動産
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7	5	46	6,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	45	32	51	6,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	0.46	0.23	11	1,521	運輸
CDW CORP/DE	4	3	56	7,319	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2	1	27	3,596	半導体・半導体製造装置
ARISTA NETWORKS INC	1	5	59	7,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	6	4	21	2,772	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	6	4	37	4,909	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	6	4	30	3,932	ソフトウェア・サービス
ZENDESK INC	3	3	30	3,913	ソフトウェア・サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	2	2	10	1,379	小売
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4	4	19	2,510	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4	1	6	873	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7	4	28	3,733	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	1	1	24	3,134	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.84	0.6	28	3,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	1	0.92	29	3,881	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4	3	141	18,385	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	3	2	71	9,272	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	4	3	20	2,702	資本財
UGI CORP	7	5	19	2,494	公益事業
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7	5	25	3,338	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	11	8	49	6,463	資本財
IHS MARKIT LTD	14	—	—	—	商業・専門サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8	6	35	4,643	ソフトウェア・サービス
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3	1	13	1,801	ソフトウェア・サービス
COUPA SOFTWARE INC	2	1	11	1,557	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC	14	9	32	4,252	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5	—	—	—	食品・飲料・タバコ
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2	—	—	—	保険
TELEFLEX INC	1	1	31	4,059	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4	3	56	7,290	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A	4	4	39	5,120	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4	2	30	3,957	各種金融
SNAP INC - A	33	27	59	7,771	メディア・娯楽

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	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4	—	—	—	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2	1	26	3,412	保険
ROLLINS INC	8	5	17	2,261	商業・専門サービス
XPO LOGISTICS INC	3	—	—	—	運輸
FAIR ISAAC CORP	1	0.65	22	2,961	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	27	20	67	8,816	エネルギー
OKTA INC	4	3	31	4,099	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	18	13	83	10,774	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3	3	18	2,442	運輸
BLACK KNIGHT INC	6	4	28	3,671	ソフトウェア・サービス
SEA LTD-ADR	—	8	46	5,995	メディア・娯楽
BLOCK INC	13	12	91	11,848	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	16	10	26	3,423	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	13	10	44	5,749	資本財
NOVOCURE LTD	3	2	13	1,781	ヘルスケア機器・サービス
HUBSPOT INC	1	1	35	4,545	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	1	1	34	4,418	ソフトウェア・サービス
PTC INC	4	2	29	3,886	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	2	2	28	3,650	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	14	10	589	76,537	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	9	6	40	5,283	公益事業
ALTICE USA INC- A	9	—	—	—	メディア・娯楽
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1	11	47	6,197	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1	0.72	11	1,526	保険
DOCUSIGN INC	6	5	34	4,509	ソフトウェア・サービス
TELADOC HEALTH INC	4	3	10	1,421	ヘルスケア機器・サービス
LINDE PLC	18	12	389	50,491	素材
WIX.COM LTD	2	1	8	1,097	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	11	9	25	3,255	各種金融
BURLINGTON STORES INC	2	1	30	3,984	小売
KKR & CO INC	17	13	66	8,649	各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16	10	22	2,917	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	12	8	218	28,296	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	9	7	32	4,218	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	5	26	3,413	消費者サービス
MONGODB INC	1	1	35	4,621	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	13	8	28	3,645	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	3	3	10	1,300	メディア・娯楽
DOW INC	27	18	124	16,138	素材
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6	5	46	6,041	ソフトウェア・サービス
AVALARA INC	2	2	15	2,030	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	11	8	16	2,080	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	3	2	53	7,006	ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	35	36	83	10,775	運輸
CORTEVA INC	26	18	98	12,819	素材
AMCOR PLC	56	38	48	6,285	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6	4	67	8,790	ソフトウェア・サービス
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	16	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3	2	17	2,218	各種金融
ROKU INC	4	2	23	3,034	メディア・娯楽
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5	3	27	3,526	商業・専門サービス
DATADOG INC - CLASS A	6	5	54	7,010	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	
LYFT INC-A		—	6	12	1,561	運輸
PINTEREST INC- CLASS A		18	14	27	3,571	メディア・娯楽
CABLE ONE INC		0.2	0.14	14	1,939	メディア・娯楽
CARVANA CO		2	1	5	731	小売
CHEWY INC - CLASS A		3	2	5	681	小売
PELOTON INTERACTIVE INC-A		9	6	8	1,092	耐久消費財・アパレル
ETSY INC		4	3	24	3,231	小売
AVANTOR INC		20	14	42	5,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MODERNA INC		9	8	107	13,951	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		2	2	7	1,029	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CLARIVATE PLC		—	8	12	1,578	商業・専門サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC		5	3	17	2,300	ソフトウェア・サービス
DYNATRACE INC		7	4	14	1,852	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A		6	6	36	4,673	ソフトウェア・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A		2	2	12	1,616	ソフトウェア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC		5	3	27	3,588	素材
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		56	37	24	3,159	各種金融
AGNC INVESTMENT CORP		17	13	16	2,082	各種金融
BILL.COM HOLDINGS INC		—	2	19	2,529	ソフトウェア・サービス
PPD INC		4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAC HOLDINGS INC		2	1	37	4,832	資本財
AON PLC-CLASS A		8	5	153	19,881	保険
OTIS WORLDWIDE CORP		14	10	75	9,810	資本財
CARRIER GLOBAL CORP		31	20	77	10,029	資本財
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC		6	—	—	—	各種金融
CARLYLE GROUP INC/THE		4	4	15	2,009	各種金融
CATALENT INC		6	4	41	5,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MATCH GROUP INC		8	6	47	6,145	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP		3	2	15	2,031	メディア・娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC		—	7	28	3,655	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A		1	5	71	9,294	ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC		4	4	9	1,172	資本財
ASANA INC - CL A		—	2	3	486	ソフトウェア・サービス
FIVERR INTERNATIONAL LTD		—	1	3	394	小売
ROYALTY PHARMA PLC- CL A		5	9	36	4,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITY SOFTWARE INC		—	1	4	574	ソフトウェア・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A		—	40	27	3,544	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC		46	32	33	4,367	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DRAFTKINGS INC - CL A		6	—	—	—	消費者サービス
ENPHASE ENERGY INC		4	3	49	6,425	半導体・半導体製造装置
DOORDASH INC - A		—	3	17	2,316	小売
KORNIT DIGITAL LTD		—	1	3	488	資本財
AIRBNB INC-CLASS A		1	7	85	11,138	消費者サービス
AFFIRM HOLDINGS INC		—	4	5	759	ソフトウェア・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B		—	4	11	1,438	ソフトウェア・サービス
NOVAVAX INC		—	1	5	707	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UPSTART HOLDINGS INC		—	0.6	1	218	各種金融
MARVELL TECHNOLOGY INC		28	20	109	14,208	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS		—	5	39	5,064	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUTU HOLDINGS LTD-ADR		—	1	3	419	各種金融
INMODE LTD		—	2	4	544	ヘルスケア機器・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A		—	14	14	1,884	メディア・娯楽

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	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A		—	4	8	1,069	自動車・自動車部品
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A		—	1	5	697	各種金融
LUCID GROUP INC		—	11	15	1,978	自動車・自動車部品
ROBINHOOD MARKETS INC - A		—	5	4	528	各種金融
SOFI TECHNOLOGIES INC		—	15	8	1,068	各種金融
GRAB HOLDINGS LTD - CL A		—	30	7	977	運輸
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC		—	8	45	5,858	各種金融
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A		—	0.33	20	2,709	銀行
WEBSTER FINANCIAL CORP		—	4	18	2,430	銀行
CONSTELLATION ENERGY		—	7	45	5,941	公益事業
WARNER BROS DISCOVERY INC		—	55	92	12,067	メディア・娯楽
DRAFTKINGS INC-CL A		—	7	8	1,059	消費者サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		27	27	12	1,646	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		7	5	26	3,435	資本財
小計		株数・金額	11,339	8,113	86,162	11,181,288
銘柄数<比率>			593	607	—	<69.1%>
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA		52	36	455	45,468	銀行
IMPERIAL OIL LTD		8	6	37	3,731	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP		5	4	50	5,087	商業・専門サービス
TC ENERGY CORP		33	25	174	17,445	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		14	9	58	5,799	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC		21	15	94	9,401	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B		18	12	57	5,776	素材
BARRICK GOLD CORP		62	45	124	12,402	素材
BCE INC		4	1	6	681	電気通信サービス
BALLARD POWER SYSTEMS INC		8	4	3	314	資本財
BANK OF MONTREAL		23	16	210	21,012	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		47	36	219	21,901	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA		43	31	249	24,962	銀行
BAUSCH HEALTH COS INC		10	8	10	1,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC		12	7	19	1,937	資本財
CAMECO CORP		12	10	27	2,700	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		16	11	149	14,986	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		42	30	228	22,796	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO		26	18	260	26,009	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		2	1	16	1,641	小売
ENBRIDGE INC		72	51	285	28,570	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		1	0.6	40	4,001	保険
CGI INC		8	5	50	5,055	ソフトウェア・サービス
IGM FINANCIAL INC		4	2	7	718	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD		7	4	44	4,448	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP		67	49	119	11,923	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC		10	7	51	5,129	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA		11	8	71	7,107	銀行
ONEX CORPORATION		2	2	14	1,429	各種金融
POWER CORP OF CANADA		22	15	52	5,291	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		19	12	40	4,080	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC		58	37	171	17,100	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD		3	2	32	3,213	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		5	23	205	20,517	運輸
AGNICO EAGLE MINES LTD		8	11	79	7,958	素材

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
KINROSS GOLD CORP	40	31	17	1,734	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	12	8	26	2,642	保険
TMX GROUP LTD	2	1	13	1,324	各種金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9	6	22	2,292	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	10	7	17	1,796	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	25	16	10	1,015	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	11	11	34	3,416	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20	16	52	5,285	素材
YAMANA GOLD INC	45	—	—	—	素材
FORTIS INC	15	12	75	7,578	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	30	—	—	—	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	31	16	16	1,613	素材
PAN AMERICAN SILVER CORP	6	6	17	1,710	素材
TORONTO-DOMINION BANK	66	46	426	42,598	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	7	5	91	9,101	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	15	11	59	5,931	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	5	5	20	2,054	食品・生活必需品小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6	3	11	1,171	公益事業
METRO INC/CN	10	6	40	4,092	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	11	7	32	3,267	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	5	4	69	6,992	保険
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3	3	22	2,272	商業・専門サービス
CENOVUS ENERGY INC	49	33	82	8,283	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	—	8	55	5,524	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	21	14	71	7,099	エネルギー
DOLLARAMA INC	10	7	47	4,765	小売
KEYERA CORP	10	5	16	1,624	エネルギー
ALTAGAS LTD	13	8	22	2,262	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	4	—	—	—	公益事業
INTER PIPELINE LTD	9	—	—	—	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.75	0.5	96	9,666	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	8	6	44	4,412	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3	2	22	2,218	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5	4	21	2,163	素材
HYDRO ONE LTD	10	8	27	2,768	公益事業
EMERA INC	10	7	43	4,383	公益事業
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	18	17	1,771	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	4	2	120	12,009	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	20	14	187	18,760	素材
WSP GLOBAL INC	4	3	40	4,060	資本財
CANOPY GROWTH CORP	7	7	4	450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IA FINANCIAL CORP INC	2	3	19	1,966	保険
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9	—	—	—	素材
QUEBECOR INC -CL B	8	4	11	1,123	メディア・娯楽
B2GOLD CORP	41	—	—	—	素材
AIR CANADA	7	7	14	1,471	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	25	16	27	2,796	公益事業
PARKLAND CORP	7	4	13	1,336	エネルギー
SSR MINING INC	9	—	—	—	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3	3	13	1,354	公益事業
FIRSTSERVICE CORP	1	1	15	1,517	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	8	5	17	1,768	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	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		8	5	19	1,909	公益事業	
TOROMONT INDUSTRIES LTD		2	2	21	2,161	資本財	
LIGHTSPEED COMMERCE INC		—	3	6	615	ソフトウェア・サービス	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG		—	2	10	1,072	ソフトウェア・サービス	
TFI INTERNATIONAL INC		—	2	20	2,010	運輸	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC		—	22	120	12,073	食品・生活必需品小売り	
小 計		株 数 ・ 金 額	1,459	1,003	6,053	604,950	
銘 柄 数 < 比 率 >			87	86	—	<3.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ			
COMMERZBANK AG		29	24	15	2,064	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		67	52	48	6,664	各種金融	
SIEMENS AG-REG		27	19	226	30,900	資本財	
RWE AG		24	16	66	9,021	公益事業	
BASF SE		32	23	115	15,770	素材	
VOLKSWAGEN AG		1	0.85	16	2,292	自動車・自動車部品	
MERCEDES-BENZ GROUP AG		30	21	138	18,918	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF		6	4	25	3,527	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE		73	57	58	7,986	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		12	8	67	9,201	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG		34	24	144	19,730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALLIANZ SE-REG		14	10	212	29,028	保険	
CONTINENTAL AG		3	2	18	2,544	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG		46	33	88	12,136	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		4	3	29	4,055	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		11	11	7	1,057	運輸	
DEUTSCHE POST AG-REG		35	25	95	12,979	運輸	
SAP SE		37	26	245	33,596	ソフトウェア・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG		7	4	78	10,715	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & ADIDAS AG		7	5	30	4,225	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		6	4	87	11,996	耐久消費財・アパレル	
MUNCHENER RUECKVER AG-REG		119	82	144	19,713	電気通信サービス	
BEIERSDORF AG		5	3	81	11,092	保険	
HEIDELBERGCEMENT AG		3	2	23	3,256	家庭用品・パーソナル用品	
MERCK KGAA		4	3	18	2,541	素材	
VOLKSWAGEN AG-PREF		4	3	55	7,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PUMA SE		6	4	68	9,336	自動車・自動車部品	
LANXESS AG		3	2	17	2,371	耐久消費財・アパレル	
FRESENIUS SE & CO KGAA		2	2	8	1,182	素材	
HOCHTIEF AG		15	10	34	4,771	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE		1	—	—	—	資本財	
GEA GROUP AG		13	—	—	—	不動産	
SYMRISE AG		3	3	12	1,679	資本財	
HENKEL AG & CO KGAA		5	3	34	4,662	素材	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		4	3	19	2,612	家庭用品・パーソナル用品	
RATIONAL AG		4	2	8	1,122	電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		0.21	0.13	6	942	資本財	
HANNOVER RUECK SE		2	1	11	1,629	自動車・自動車部品	
BRENNTAG SE		2	1	22	3,071	保険	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		4	4	27	3,760	資本財	
FUCHS PETROLUB SE-PREF		1	1	11	1,548	ヘルスケア機器・サービス	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		3	1	4	588	素材	
		48	18	5	733	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		2	1	18	2,573	不動産
VONOVIA SE		20	18	64	8,769	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG		6	6	15	2,108	素材
ZALANDO SE		5	5	18	2,508	小売
COVESTRO AG		6	4	19	2,620	素材
UNIPER SE		5	2	5	797	公益事業
KION GROUP AG		3	1	7	986	資本財
MTU AERO ENGINES AG		1	1	23	3,270	資本財
DELIVERY HERO SE		5	4	11	1,530	小売
SCOUT24 SE		3	1	11	1,628	メディア・娯楽
SARTORIUS AG-VORZUG		1	0.62	20	2,794	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		9	7	37	5,106	ヘルスケア機器・サービス
NEMETSCHKE SE		2	1	8	1,149	ソフトウェア・サービス
BECHTLE AG		1	1	7	1,017	ソフトウェア・サービス
KNORR-BREMSE AG		2	1	10	1,477	資本財
HELLOFRESH SE		6	4	14	1,936	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG		7	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SIEMENS ENERGY AG		16	10	16	2,276	資本財
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		—	10	27	3,785	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	879	623	2,774	378,965	
	銘柄 数 < 比 率 >	61	59	—	<2.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		35	28	49	6,808	保険
INTESA SANPAOLO		600	417	80	11,060	銀行
TELECOM ITALIA SPA		28	297	8	1,101	電気通信サービス
ENI SPA		91	62	85	11,702	エネルギー
UNICREDIT SPA		71	53	50	6,851	銀行
ENEL SPA		292	205	122	16,746	公益事業
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		2	2	10	1,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLANTIA SPA		18	11	26	3,642	運輸
MEDIOBANCA SPA		29	16	15	2,162	銀行
SNAM SPA		82	52	27	3,726	公益事業
TELECOM ITALIA-RSP		279	—	—	—	電気通信サービス
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE		53	36	28	3,832	公益事業
PRYSMIAN SPA		8	6	18	2,497	資本財
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		11	7	7	1,047	電気通信サービス
POSTE ITALIANE SPA		15	15	13	1,894	保険
FINECOBANK SPA		22	15	18	2,556	銀行
MONCLER SPA		7	4	21	2,969	耐久消費財・アパレル
DIASORIN SPA		1	0.77	8	1,204	ヘルスケア機器・サービス
AMPLIFON SPA		5	3	10	1,443	ヘルスケア機器・サービス
NEXI SPA		17	13	12	1,744	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,674	1,249	618	84,478	
	銘柄 数 < 比 率 >	20	19	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)		5	4	50	6,951	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		10	7	402	55,017	耐久消費財・アパレル
AXA SA		67	49	113	15,491	保険
DANONE		21	16	91	12,468	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA		17	15	32	4,402	食品・生活必需品小売り
VIVENDI SE		31	20	22	3,116	メディア・娯楽
SOCIETE GENERALE SA		31	20	46	6,356	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE SA	17	12	190	25,976	素材
TOTALENERGIES SE	91	63	319	43,633	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	17	12	67	9,260	資本財
VINCI SA	18	13	124	16,969	資本財
SANOFI	40	28	281	38,480	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	21	16	43	5,892	公益事業
L' OREAL	9	6	205	28,131	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	5	3	10	1,427	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	19	13	174	23,875	資本財
BNP PARIBAS	39	28	148	20,292	銀行
ESSILORLUXOTTICA	9	7	107	14,656	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE	6	4	73	9,989	ソフトウェア・サービス
VALEO	8	5	9	1,313	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	1	0.81	85	11,660	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA	3	2	15	2,145	消費者サービス
KERING	2	1	87	11,926	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SE	4	16	64	8,813	ソフトウェア・サービス
ATOS SE	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ORANGE	73	50	58	7,990	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	8	4	8	1,178	保険
SAFRAN SA	11	8	83	11,351	資本財
RENAULT SA	6	4	10	1,403	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	8	5	31	4,266	メディア・娯楽
BOUYGUES SA	8	6	19	2,717	資本財
THALES SA	3	2	32	4,372	資本財
PERNOD RICARD SA	7	5	98	13,485	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	44	29	30	4,156	銀行
ENGIE	63	46	52	7,145	公益事業
ALSTOM	10	8	17	2,414	資本財
ARKEMA	2	1	20	2,743	素材
LEGRAND SA	9	6	54	7,473	資本財
SCOR SE	4	—	—	—	保険
ADP	1	0.62	8	1,102	運輸
EDF	23	15	13	1,841	公益事業
NATIXIS	44	—	—	—	各種金融
WENDEL	1	0.66	5	809	各種金融
BUREAU VERITAS SA	10	7	18	2,513	商業・専門サービス
EURAZEO SE	1	0.89	6	841	各種金融
SUEZ	8	—	—	—	公益事業
EIFFAGE	3	2	20	2,739	資本財
ILIAD SA	0.69	—	—	—	電気通信サービス
ORPEA	1	1	4	632	ヘルスケア機器・サービス
BIOMERIEUX	1	1	10	1,464	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE	15	10	17	2,401	運輸
EDENRED	8	6	28	3,928	ソフトウェア・サービス
REMY COINTREAU	1	0.59	10	1,396	食品・飲料・タバコ
BOLLORE SE	4	22	10	1,471	メディア・娯楽
DASSAULT AVIATION SA	0.12	0.54	8	1,149	資本財
SEB SA	1	0.52	5	762	耐久消費財・アパレル
IPSEN	1	0.84	7	1,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	1	1	9	1,253	各種金融
FAURECIA	3	3	7	1,038	自動車・自動車部品

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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEPERFORMANCE	2	1	46	6,340	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	3	2	9	1,352	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1	0.73	21	2,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA	8	6	21	2,936	ソフトウェア・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4	2	6	886	消費者サービス
EUROAPI SASU	—	1	1	234	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	923	643	3,587	490,041
	銘柄数<比率>	64	60	—	<3.0%>
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	8	5	25	3,447	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	40	25	34	4,737	資本財
STELLANTIS NV	73	51	67	9,285	自動車・自動車部品
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	17	12	12	1,657	食品・飲料・タバコ
FERRARI NV	4	3	59	8,071	自動車・自動車部品
EXOR NV	3	2	18	2,499	各種金融
AIRBUS SE	20	14	160	21,916	資本財
STMICROELECTRONICS NV	22	17	59	8,150	半導体・半導体製造装置
EURONEXT NV	—	2	15	2,063	各種金融
WOLTERS KLUWER	9	6	62	8,522	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV	152	84	27	3,779	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.	6	4	38	5,206	素材
HEINEKEN NV	8	6	61	8,446	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	31	23	54	7,447	ヘルスケア機器・サービス
AEGON NV	49	42	20	2,810	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40	26	69	9,518	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV	3	2	14	1,955	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	4	2	20	2,821	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	6	4	63	8,660	素材
ING GROEP NV	145	99	87	12,017	銀行
ASML HOLDING NV	15	10	537	73,445	半導体・半導体製造装置
VOPAK	3	—	—	—	エネルギー
NN GROUP NV	9	7	33	4,538	保険
ABN AMRO BANK NV-CVA	19	9	10	1,431	銀行
IMCD NV	—	1	18	2,511	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	1	1	32	4,417	半導体・半導体製造装置
ADYEN NV	0.64	0.5	68	9,373	ソフトウェア・サービス
JUST EAT TAKEAWAY	4	4	7	1,014	小売
PROSUS NV	17	23	102	13,952	小売
JDE PEET'S NV	3	3	8	1,186	食品・飲料・タバコ
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	18	36	5,030	メディア・娯楽
ARGENX SE	1	1	32	4,496	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	727	520	1,862	254,415
	銘柄数<比率>	29	31	—	<1.6%>
(ユーロ…スペイン)					
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8	6	8	1,099	資本財
ENDESA SA	11	7	14	2,024	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6	6	16	2,218	資本財
IBERDROLA SA	222	146	159	21,820	公益事業
TELEFONICA SA	200	133	62	8,488	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	609	438	117	16,112	銀行
REPSOL SA	57	36	52	7,143	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	227	168	79	10,917	銀行

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	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NATURGY ENERGY GROUP SA		7	4	14	1,913	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		41	27	54	7,427	小売
FERROVIAL SA		17	12	28	3,932	資本財
FERROVIAL SA-RTS		—	12	0.33411	45	資本財
ENAGAS SA		11	7	15	2,108	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		16	11	22	3,009	公益事業
CAIXABANK SA		162	112	33	4,541	銀行
GRIFOLS SA		11	6	12	1,719	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		16	11	66	9,116	ソフトウェア・サービス
AENA SME SA		2	1	25	3,434	運輸
CELLNEX TELECOM SA		11	12	52	7,198	電気通信サービス
EDP RENOVAVEIS SA		—	7	15	2,138	公益事業
小 計	株数・金額	1,641	1,172	852	116,410	
	銘柄数<比率>	18	20	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV		1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGEAS		6	4	17	2,429	保険
UCB SA		5	3	35	4,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		3	2	24	3,302	各種金融
UMICORE		6	4	19	2,702	素材
COLRUYT SA		2	0.99	3	464	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		7	6	36	5,036	銀行
SOLVAY SA		2	1	16	2,282	素材
PROXIMUS		7	1	2	400	電気通信サービス
SOFINA		0.72	0.37	10	1,406	各種金融
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		26	22	117	15,985	食品・飲料・タバコ
ELIA GROUP SA/NV		1	0.36	5	740	公益事業
小 計	株数・金額	73	49	289	39,548	
	銘柄数<比率>	12	11	—	<0.2%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		6	9	25	3,520	銀行
VERBUND AG		3	1	14	2,032	公益事業
OMV AG		6	3	17	2,326	エネルギー
VOESTALPINE AG		5	3	8	1,113	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		6	3	3	498	銀行
小 計	株数・金額	28	21	69	9,491	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
AROUNDTOWN SA		41	23	11	1,531	不動産
TENARIS SA		22	11	16	2,202	エネルギー
SES		17	—	—	—	メディア・娯楽
EUROFINS SCIENTIFIC		4	3	28	3,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		22	16	43	5,899	素材
INPOST SA		—	7	3	539	運輸
小 計	株数・金額	109	61	102	14,026	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		209	136	63	8,611	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		22	14	26	3,649	素材
UPM-KYMMENE OYJ		19	14	45	6,180	素材
FORTUM OYJ		17	11	18	2,479	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		11	7	16	2,316	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		11	8	35	4,858	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		15	12	56	7,768	保険
WARTSILA OYJ ABP		20	10	7	996	資本財
ELISA OYJ		5	3	18	2,568	電気通信サービス
NESTE OYJ		16	10	41	5,601	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		4	3	10	1,478	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	353	231	340	46,509	
	銘 柄 数 < 比 率 >	11	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		5	4	39	5,442	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		5	3	29	4,025	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI		6	4	41	5,734	消費者サービス
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		8	6	23	3,243	素材
CRH PLC		28	19	71	9,787	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	55	37	206	28,234	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		101	71	32	4,408	公益事業
JERONIMO MARTINS		11	7	14	1,921	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		10	10	10	1,472	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	124	88	57	7,802	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	6,590	4,700	10,762	1,469,924	
	銘 柄 数 < 比 率 >	233	229	—	<9.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		637	422	62	9,901	銀行
BP PLC		725	499	209	33,312	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		2,628	1,795	77	12,301	銀行
ASTRAZENECA PLC		47	39	392	62,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC		14	9	13	2,105	資本財
NEXT PLC		5	3	21	3,357	小売
DIAGEO PLC		84	58	221	35,222	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC		109	80	59	9,513	資本財
UNILEVER PLC		94	64	239	38,071	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC		264	194	53	8,511	食品・生活必需品小売り
RELX PLC		68	49	112	17,907	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		25	18	115	18,338	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC		10	9	21	3,386	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC		93	69	65	10,396	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		214	145	35	5,623	保険
SAGE GROUP PLC/THE		46	26	17	2,796	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC		738	514	256	40,838	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		82	55	185	29,474	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		25	18	20	3,277	公益事業
SCHRODERS PLC		5	2	8	1,320	各種金融
NATWEST GROUP PLC		186	138	28	4,537	銀行
BHP GROUP PLC		75	—	—	—	素材
IMPERIAL BRANDS PLC		32	23	40	6,447	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		46	30	29	4,730	メディア・娯楽
BT GROUP PLC		310	226	39	6,345	電気通信サービス
SSE PLC		36	27	51	8,136	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		90	64	37	5,881	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		330	222	17	2,840	資本財
COMPASS GROUP PLC		66	45	76	12,198	消費者サービス
KINGFISHER PLC		77	54	13	2,155	小売
PEARSON PLC		25	19	14	2,321	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC		8	6	19	3,123	公益事業
RIO TINTO PLC		40	28	151	24,145	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		178	127	221	35,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC		33	24	31	5,004	各種金融
VODAFONE GROUP PLC		1,006	692	82	13,072	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS		51	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC		83	49	11	1,812	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC		152	95	39	6,211	保険
JOHNSON MATTHEY PLC		5	5	12	1,946	素材
RENTOKIL INITIAL PLC		62	48	24	3,913	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP LTD		38	—	—	—	保険
WHITBREAD PLC		7	4	11	1,888	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		129	91	109	17,456	公益事業
BUNZL PLC		9	8	25	3,989	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		45	32	109	17,451	素材
INTERTEK GROUP PLC		5	3	19	3,065	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		14	10	16	2,626	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		4	4	23	3,803	消費者サービス
PERSIMMON PLC		10	8	16	2,696	耐久消費財・アパレル
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		11	8	60	9,546	各種金融
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		4	2	11	1,809	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		38	22	10	1,733	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC		28	22	27	4,419	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		131	88	10	1,718	耐久消費財・アパレル
SHELL PLC		143	—	—	—	エネルギー
SHELL PLC		132	—	—	—	エネルギー
ABRDN PLC		85	61	11	1,792	各種金融
EXPERIAN PLC		34	23	62	9,900	商業・専門サービス
MONDI PLC		16	12	19	3,050	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		13	10	16	2,568	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC		10	9	13	2,139	素材
ADMIRAL GROUP PLC		6	4	10	1,744	保険
FRESNILLO PLC		7	—	—	—	素材
ST JAMES'S PLACE PLC		19	13	16	2,611	各種金融
GLENCORE PLC		351	251	119	18,998	素材
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		2	1	21	3,352	資本財
EVRAZ PLC		23	—	—	—	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		7	9	8	1,285	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC		5	3	22	3,645	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC		189	117	13	2,112	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI		6	4	7	1,135	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		64	—	—	—	保険
AVEVA GROUP PLC		3	2	5	901	ソフトウェア・サービス
ASHTED GROUP PLC		16	11	43	6,876	資本財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		6	3	6	992	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OCADO GROUP PLC		17	11	8	1,335	食品・生活必需品小売り
AUTO TRADER GROUP PLC		27	22	12	2,001	メディア・娯楽
DCC PLC		3	2	15	2,453	資本財

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	
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ENTAIN PLC		18	14	19	3,049	消費者サービス
INFORMA PLC		44	38	20	3,292	メディア・娯楽
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		22	17	10	1,652	保険
FERGUSON PLC		8	5	52	8,367	資本財
M&G PLC		86	66	14	2,227	各種金融
JD SPORTS FASHION PLC		20	67	8	1,274	小売
SHELL PLC		—	194	450	71,669	エネルギー
小計	株数・金額	10,701	7,298	4,597	730,654	
	銘柄数＜比率＞	85	78	—	<4.5%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		103	71	867	113,244	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		18	13	142	18,579	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		90	65	41	5,443	各種金融
HOLCIM LTD		19	13	61	8,030	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		25	17	583	76,134	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG		0.33	0.23	81	10,587	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		1	1	45	5,903	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		5	3	169	22,153	保険
BACHEM HOLDING AG-REG B		—	0.9	6	820	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STRAUMANN HOLDING AG-REG		0.41	2	29	3,813	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG		2	1	99	13,047	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		2	0.93	4	565	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		1	0.95	17	2,258	資本財
GEBERIT AG-REG		1	0.92	47	6,142	資本財
SWISS RE AG		10	7	61	8,086	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR		0.85	0.81	19	2,592	耐久消費財・アパレル
NOVARTIS AG-REG		79	55	469	61,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		5	3	12	1,575	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG		1	0.67	38	5,074	電気通信サービス
ABB LTD-REG		68	41	118	15,457	資本財
CLARIANT AG-REG		9	5	8	1,149	素材
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		5	4	26	3,444	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR		0.85	0.8	28	3,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG		0.2	0.15	36	4,705	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		0.3	0.63	11	1,487	資本財
TEMENOS AG - REG		2	1	17	2,234	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		2	1	32	4,301	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG		1	1	17	2,268	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		0.94	0.79	42	5,583	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.01	—	—	—	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD		9	6	28	3,662	各種金融
SIKA AG-REG		4	3	93	12,219	素材
SWISS PRIME SITE-REG		2	2	20	2,665	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.01	0.05	48	6,279	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG		0.69	0.58	59	7,746	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.08	0.09	19	2,587	食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		1	—	—	—	銀行
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		0.26	0.17	13	1,794	素材
UBS GROUP AG-REG		130	88	150	19,700	各種金融
VIFOR PHARMA AG		1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VAT GROUP AG		—	0.67	18	2,379	資本財
ALCON INC		18	12	89	11,627	ヘルスケア機器・サービス

銘柄		株数	株数	当期		業種等
				期末		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
VIFOR PHARMA AG-NEW		—	0.84	14	1,928	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	631	436	3,694	482,290	
	銘柄数<比率>	40	40	—	<3.0%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-B		4	4	69	897	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		102	73	566	7,307	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS		13	9	365	4,715	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		52	41	441	5,695	銀行
INVESTOR AB-B SHS		16	46	798	10,296	各種金融
GETINGE AB-B SHS		—	5	164	2,119	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		62	35	343	4,426	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS		24	17	755	9,740	資本財
SKF AB-B SHARES		15	9	157	2,031	資本財
ASSA ABLOY AB-B		37	25	586	7,563	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		31	19	231	2,986	小売
SANDVIK AB		38	28	540	6,965	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES		37	23	343	4,428	銀行
SECURITAS AB-B SHS		14	8	94	1,211	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B		23	15	280	3,610	素材
SKANSKA AB-B SHS		12	7	133	1,720	資本財
SWEDISH MATCH AB		65	38	396	5,109	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		14	14	187	2,415	電気通信サービス
TELIA CO AB		93	68	276	3,563	電気通信サービス
VOLVO AB-A SHS		—	4	73	947	資本財
VOLVO AB-B SHS		54	36	583	7,522	資本財
ALFA LAVAL AB		11	7	198	2,559	資本財
LUNDIN ENERGY AB		3	5	215	2,775	エネルギー
BOLIDEN AB		10	7	259	3,350	素材
BOLIDEN AB-RED SHS		10	7	10	141	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		10	10	91	1,177	資本財
HEXAGON AB-B SHS		10	49	571	7,362	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B		9	5	96	1,242	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		2	5	134	1,729	各種金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		4	2	125	1,622	不動産
ICA GRUPPEN AB		2	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		11	35	298	3,850	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS		3	2	98	1,274	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B		19	14	385	4,972	家庭用品・パーソナル用品
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		4	2	57	744	各種金融
EPIROC AB-B		10	10	158	2,045	資本財
EPIROC AB-A		28	16	298	3,853	資本財
NORDEA BANK ABP		110	81	780	10,057	銀行
EQT AB		8	8	219	2,835	各種金融
EVOLUTION AB		5	4	424	5,467	消費者サービス
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		7	4	93	1,203	資本財
SINCH AB		—	16	65	846	ソフトウェア・サービス
EMBRACER GROUP AB		—	13	88	1,140	メディア・娯楽
INVESTOR AB-A SHS		—	13	242	3,122	各種金融
LIFCO AB-B SHS		—	5	89	1,155	資本財
SAGAX AB-B		—	3	67	866	不動産
小計	株数・金額	998	864	12,465	160,676	
	銘柄数<比率>	39	45	—	<1.0%>	

銘柄	株数	金額	株数	金額	業種等
期首(前期末)	株数	金額	株数	金額	業種等
当	株数	金額	株数	金額	業種等
期	株数	金額	株数	金額	業種等
末	株数	金額	株数	金額	業種等
評価	株数	金額	株数	金額	業種等
外貨建金額	株数	金額	株数	金額	業種等
邦貨換算金額	株数	金額	株数	金額	業種等
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
DNB ASA	37	—	—	—	銀行
NORSK HYDRO ASA	33	32	220	2,933	素材
ORKLA ASA	26	18	137	1,827	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	33	25	826	11,012	エネルギー
TELENOR ASA	25	17	220	2,944	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	5	4	183	2,448	素材
MOWI ASA	14	11	277	3,698	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9	5	108	1,446	保険
SCHIBSTED ASA-CL A	3	1	25	336	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	4	2	37	496	メディア・娯楽
AKER BP ASA	—	3	111	1,481	エネルギー
ADEVINTA ASA	10	5	32	433	メディア・娯楽
DNB BANK ASA	—	23	422	5,627	銀行
小計	株数・金額	203	150	2,602	34,687
銘柄数<比率>	11	12	—	<0.2%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	61	42	3,182	58,425	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	8	5	216	3,979	素材
DANSKE BANK A/S	21	16	177	3,256	銀行
DEMANT A/S	5	2	66	1,225	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S	3	—	—	—	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	33	25	396	7,280	資本財
GN STORE NORD A/S	3	3	69	1,282	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	4	2	218	4,019	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	3	3	264	4,860	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	7	5	538	9,895	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.27	0.15	290	5,328	運輸
TRYG A/S	5	8	136	2,514	保険
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.05	0.08	151	2,784	運輸
PANDORA A/S	3	2	137	2,527	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	3	2	143	2,637	素材
GENMAB A/S	2	1	346	6,354	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S	7	4	341	6,270	公益事業
ROCKWOOL A/S-B SHS	0.33	0.21	37	680	資本財
AMBU A/S-B	5	5	49	908	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	182	132	6,766	124,233
銘柄数<比率>	19	18	—	<0.8%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
BHP GROUP LTD	106	127	584	52,623	素材
CSL LTD	16	12	334	30,150	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WOODSIDE PETROLEUM LTD	36	24	75	6,843	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	100	71	181	16,319	銀行
RIO TINTO LTD	12	9	99	8,952	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	53	37	46	4,208	保険
LENDLEASE GROUP	30	15	17	1,606	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	64	43	438	39,447	銀行
WESTPAC BANKING CORP	127	92	225	20,271	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	115	82	252	22,777	銀行
BRAMBLES LTD	54	36	38	3,480	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	34	23	12	1,111	運輸
WOOLWORTHS GROUP LTD	44	30	116	10,447	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	140	112	43	3,944	電気通信サービス

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
(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	161	—	—	—	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	95	58	29	2,662	消費者サービス
COMPUTERSHARE LTD	12	12	29	2,677	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	20	15	49	4,424	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	11	8	156	14,072	各種金融
CIMIC GROUP LTD	4	—	—	—	資本財
ASX LTD	6	4	40	3,609	各種金融
COCHLEAR LTD	1	1	34	3,089	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	18	11	45	4,127	素材
NEWCREST MINING LTD	27	20	51	4,674	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	99	63	29	2,660	保険
ORIGIN ENERGY LTD	36	38	26	2,387	公益事業
ORICA LTD	18	9	14	1,327	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	18	11	40	3,687	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	57	81	65	5,854	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	46	31	36	3,302	保険
TRANSURBAN GROUP	103	77	109	9,828	運輸
WESFARMERS LTD	42	28	141	12,768	小売
BLUESCOPE STEEL LTD	14	12	21	1,944	素材
SYDNEY AIRPORT	51	—	—	—	運輸
AMPOL LTD	11	5	18	1,637	エネルギー
OIL SEARCH LTD	92	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD	26	—	—	—	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	64	46	90	8,123	素材
AUSNET SERVICES	87	—	—	—	公益事業
CROWN RESORTS LTD	17	8	11	1,006	消費者サービス
AURIZON HOLDINGS LTD	52	52	21	1,898	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	33	18	20	1,814	食品・飲料・タバコ
APA GROUP	50	37	41	3,777	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4	4	33	3,033	ヘルスケア機器・サービス
SEEK LTD	9	9	24	2,221	メディア・娯楽
REA GROUP LTD	1	1	15	1,421	メディア・娯楽
MEDIBANK PRIVATE LTD	85	66	21	1,907	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	1	10	925	消費者サービス
SOUTH32 LTD	178	119	52	4,753	素材
EVOLUTION MINING LTD	75	51	18	1,650	素材
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5	—	—	—	各種金融
IDP EDUCATION LTD	—	6	15	1,401	消費者サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42	26	23	2,089	素材
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5	5	13	1,240	エネルギー
COLES GROUP LTD	41	32	61	5,494	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	6	3	15	1,372	ソフトウェア・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	—	5	27	2,443	素材
AFTERPAY LTD	7	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TPG TELECOM LTD	12	—	—	—	電気通信サービス
XERO LTD	4	3	31	2,796	ソフトウェア・サービス
REECE LTD	—	6	11	1,058	資本財
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	34	26	2,383	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	2,705	1,758	3,994	359,737
	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	36	65	31	2,559	電気通信サービス

銘柄		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	
(ニュージーランド)		百株	百株	千円	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		24	42	30	2,467	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		24	15	33	2,705	ヘルスケア機器・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD		18	10	8	727	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		59	36	16	1,372	公益事業
MERCURY NZ LTD		31	12	7	595	公益事業
A2 MILK CO LTD		31	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	227	183	127	10,427	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	6	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		10	10	43	720	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		93	68	370	6,120	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES		45	35	317	5,247	不動産
MTR CORP		50	40	172	2,853	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		375	284	239	3,953	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		62	42	120	1,988	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		40	40	217	3,587	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		43	30	976	16,136	各種金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		90	50	71	1,176	不動産
CLP HOLDINGS LTD		55	40	303	5,018	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		61	41	129	2,144	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		62	—	—	—	銀行
HANG SENG BANK LTD		24	20	278	4,605	銀行
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		14	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO		70	70	73	1,219	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		30	15	80	1,324	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		130	95	278	4,601	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		50	35	345	5,704	資本財
PCCW LTD		200	—	—	—	電気通信サービス
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		60	40	68	1,137	資本財
SANDS CHINA LTD		92	64	100	1,660	消費者サービス
WYNN MACAU LTD		72	—	—	—	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD		90	—	—	—	消費者サービス
AIA GROUP LTD		436	306	2,204	36,444	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		54	22	40	674	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		80	50	210	3,475	消費者サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		—	56	69	1,151	小売
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		60	100	112	1,857	電気通信サービス
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		—	40	103	1,702	運輸
WH GROUP LTD		355	210	112	1,857	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD		83	53	283	4,688	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		125	125	97	1,603	公益事業
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		50	40	147	2,429	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		81	37	73	1,220	食品・飲料・タバコ
ESR CAYMAN LTD		64	64	152	2,517	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	3,208	2,124	7,793	128,824	
	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		124	87	102	9,605	銀行
CAPITALAND LTD		49	—	—	—	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		21	5	3	368	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD		64	46	146	13,715	銀行
KEPPEL CORP LTD		44	35	23	2,167	資本財

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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		43	30	85	7,980	銀行
VENTURE CORP LTD		13	7	12	1,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING		18	51	20	1,900	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		280	217	61	5,736	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		63	39	20	1,912	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		38	20	18	1,754	各種金融
UOL GROUP LTD		22	6	4	395	不動産
WILMAR INTERNATIONAL LTD		49	49	20	1,922	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD		283	123	9	896	消費者サービス
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI		—	69	26	2,500	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	1,111	784	556	51,998	
	銘 柄 数 < 比 率 >	14	14	—	<0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
ICL GROUP LTD		32	19	78	2,947	素材
BANK HAPOLIM BM		28	30	92	3,483	銀行
NICE LTD		1	1	109	4,130	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL		54	43	144	5,419	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		1	0.62	43	1,623	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		54	30	57	2,150	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		6	3	42	1,595	銀行
AZRIELI GROUP LTD		1	0.97	25	951	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	181	130	592	22,300	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	39,542	27,680	—	15,361,995	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1,226	1,226	—	<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		1	1	40	5,312	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		0.52	0.376	60	7,890	0.0
PROLOGIS INC		2	1	231	30,044	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		0.374	0.26	37	4,841	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC		0.994	0.719	91	11,849	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		0.57	0.452	31	4,043	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.236	0.163	47	6,107	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		0.503	0.34	59	7,719	0.0
WELLTOWER INC		1	1	96	12,474	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		0.572	0.38	41	5,382	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		2	1	26	3,418	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM		0.384	0.295	52	6,779	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		0.825	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP		1	1	92	11,971	0.1
REGENCY CENTERS CORP		0.68	0.399	25	3,345	0.0
SUN COMMUNITIES INC		0.405	0.297	46	6,043	0.0
UDR INC		0.861	0.796	37	4,900	0.0
VENTAS INC		1	1	53	6,920	0.0
WEYERHAEUSER CO		2	1	71	9,307	0.1
AMERICAN TOWER CORP		1	1	258	33,594	0.2
WP CAREY INC		0.568	0.487	37	4,875	0.0
VEREIT INC		0.781	—	—	—	—
DUKE REALTY CORP		1	0.951	50	6,597	0.0
IRON MOUNTAIN INC		1	0.736	37	4,828	0.0
EQUINIX INC		0.317	0.228	142	18,467	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP		1	1	186	24,211	0.1
EQUITY RESIDENTIAL		1	0.907	66	8,689	0.1
INVITATION HOMES INC		2	1	54	7,095	0.0
VICI PROPERTIES INC		2	2	66	8,629	0.1
SBA COMMUNICATIONS CORP		0.379	0.275	86	11,243	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC		2	1	35	4,553	0.0
PUBLIC STORAGE		0.566	0.4	125	16,236	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC		1	0.833	94	12,216	0.1
VORNADO REALTY TRUST		0.413	0.416	14	1,825	0.0
KIMCO REALTY CORP		—	1	34	4,538	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		0.517	0.356	72	9,400	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	38	29	2,507	325,358	
	銘 柄 数 < 比 率 >	35	34	—	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		0.4	0.2	9	922	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		0.7	0.2	4	423	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1	0.4	13	1,345	
	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		0.161	0.099	10	1,398	0.0
KLEPIERRE		0.921	0.451	10	1,387	0.0
COVIVIO		0.225	0.129	8	1,146	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	0.304	21	2,931	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1	0.983	50	6,864	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		0.467	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	0.467	—	—	—	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1	0.983	50	6,864	
	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		4	2	9	1,575	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		2	1	13	2,102	0.0
SEGRO PLC		4	3	33	5,358	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	11	6	56	9,036	
	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		18	11	19	1,785	0.0
SCENTRE GROUP		21	13	37	3,347	0.0
DEXUS/AU		—	2	27	2,501	0.0
GPT GROUP		5	4	22	2,064	0.0
MIRVAC GROUP		13	9	20	1,890	0.0
STOCKLAND		8	5	21	1,941	0.0
DEXUS		3	—	—	—	—
GOODMAN GROUP		5	4	83	7,528	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	75	51	233	21,059	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		6	5	359	5,935	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	6	5	359	5,935	
	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		9	—	—	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS		—	0.079	0.09954	9	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		12	3	5	539	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		10	4	7	685	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		12	13	30	2,824	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		11	9	25	2,363	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	55	30	68	6,422	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	190	125	—	376,022	
	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	末
			買	建	売
			額		建
			額		額
外国	株式先物取引	SP EMINI	百万円		百万円
		SP/TSE60	382		—
		SWISS IX	24		—
		EURO ST	15		—
		SPI 200	59		—
		FTSE100	15		—
			23		—

(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	末
	評	価	比
			率
株式	千円		%
投資証券	15,361,995		94.0
コール・ローン等、その他	376,022		2.3
投資信託財産総額	608,326		3.7
	16,346,343		100.0

(注) 期末における外貨建純資産（16,008,875千円）の投資信託財産総額（16,346,343千円）に対する比率は97.9%です。

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

1 アメリカドル=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	33,174,679,319
コール・ローン等	396,360,891
株式(評価額)	15,361,995,392
投資証券(評価額)	376,022,996
未収入金	16,867,820,957
未収配当金	15,974,780
差入委託証拠金	156,504,303
(B) 負債	16,981,896,911
未払金	16,979,626,343
未払解約金	2,270,534
未払利息	34
(C) 純資産総額(A－B)	16,192,782,408
元本	6,852,502,538
次期繰越損益金	9,340,279,870
(D) 受益権総口数	6,852,502,538口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,630円

<注記事項>

- ①期首元本額 8,488,845,324円
 期中追加設定元本額 734,767,087円
 期中一部解約元本額 2,371,109,873円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.3630円です。

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

三菱UFJ バランスファンド2 OVA (適格機関投資家限定)	1,538,786,907円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	1,372,161,200円
三菱UFJ バランスファンド5 OVA (適格機関投資家限定)	1,052,543,552円
三菱UFJ バランスファンドVA 5 O型 (適格機関投資家限定)	1,039,836,987円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	971,237,569円
つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)	387,460,342円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	224,707,169円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	24,599,659円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	23,639,820円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	21,935,627円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	21,927,285円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	21,805,141円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	21,749,521円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	21,670,635円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	21,595,712円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	21,580,777円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	21,436,099円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	21,313,817円
ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	11,634,233円
三菱UFJ バランスファンド5 VA (適格機関投資家限定)	9,684,028円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	844,011円
ラップ向けインデックスf 先進国株式(為替ヘッジあり)	352,447円
合計	6,852,502,538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	339,052,616
受取配当金	328,560,262
受取利息	1,578
その他収益金	11,314,941
支払利息	△ 824,165
(B) 有価証券売買損益	△ 700,127,831
売買益	5,066,125,004
売買損	△ 5,766,252,835
(C) 先物取引等取引損益	△ 22,084,994
取引益	159,395,561
取引損	△ 181,480,555
(D) 保管費用等	△ 16,163,280
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 399,323,489
(F) 前期繰越損益金	12,554,999,983
(G) 追加信託差損益金	1,178,294,365
(H) 解約差損益金	△ 3,993,690,989
(I) 計(E+F+G+H)	9,340,279,870
次期繰越損益金(I)	9,340,279,870

- (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。