

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（2010年4月28日設定）	
運用方針	MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標とし、主として同じ目標で運用を行う「TMA外国株式インデックスマザーファンド」に投資します。	
主要投資対象	東京海上セレクション・外国株式インデックス	主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、このほか外国の株式等に直接投資することがあります。
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	主として外国の株式に投資します。
投資制限	東京海上セレクション・外国株式インデックス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
分配方針	<p>毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。</p> <p>ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。</p> <p>収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</p>	

## 東京海上セレクション・外国株式インデックス

### 第13期 運用報告書（全体版）

（決算日 2023年4月17日）

#### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「東京海上セレクション・外国株式インデックス」は、このたび、第13期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。  
また、一印は組み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	基準価額 (分配落)	税金 分配	期末 騰落	ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
				騰落率	騰落率				
9期(2019年4月15日)	25,433	0	11.1	1,200,119	11.9	94.2	3.2	2.5	8,852
10期(2020年4月15日)	23,081	0	△9.2	1,092,057	△9.0	93.4	4.7	2.6	14,573
11期(2021年4月15日)	34,680	0	50.3	1,652,996	51.4	94.8	3.3	2.2	36,390
12期(2022年4月15日)	42,067	0	21.3	2,009,637	21.6	94.8	3.0	2.4	31,029
13期(2023年4月17日)	43,206	0	2.7	2,072,261	3.1	96.2	1.8	2.1	42,508

(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」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ○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	ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	証券 比率
			騰落率	騰落率				
(期首)	円	%		%	%	%	%	%
2022年4月15日	42,067	—	2,009,637	—	94.8	3.0	2.4	2.4
4月末	40,683	△3.3	1,943,470	△3.3	94.1	5.6	2.5	2.5
5月末	40,607	△3.5	1,941,170	△3.4	93.5	4.1	2.3	2.3
6月末	39,653	△5.7	1,895,745	△5.7	98.0	2.0	2.5	2.5
7月末	41,208	△2.0	1,967,772	△2.1	98.2	1.9	2.5	2.5
8月末	41,467	△1.4	1,982,293	△1.4	95.3	4.8	2.4	2.4
9月末	39,412	△6.3	1,883,547	△6.3	98.1	1.9	2.3	2.3
10月末	43,176	2.6	2,066,942	2.9	98.1	1.8	2.2	2.2
11月末	41,917	△0.4	2,007,748	△0.1	94.3	5.7	2.2	2.2
12月末	39,358	△6.4	1,884,347	△6.2	95.8	4.5	2.2	2.2
2023年1月末	40,847	△2.9	1,957,033	△2.6	98.3	1.4	2.3	2.3
2月末	42,285	0.5	2,024,295	0.7	98.5	1.4	2.3	2.3
3月末	42,047	△0.0	2,015,006	0.3	99.2	1.2	2.2	2.2
(期末)								
2023年4月17日	43,206	2.7	2,072,261	3.1	96.2	1.8	2.1	2.1

(注) 騰落率は期首比です。

(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」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

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

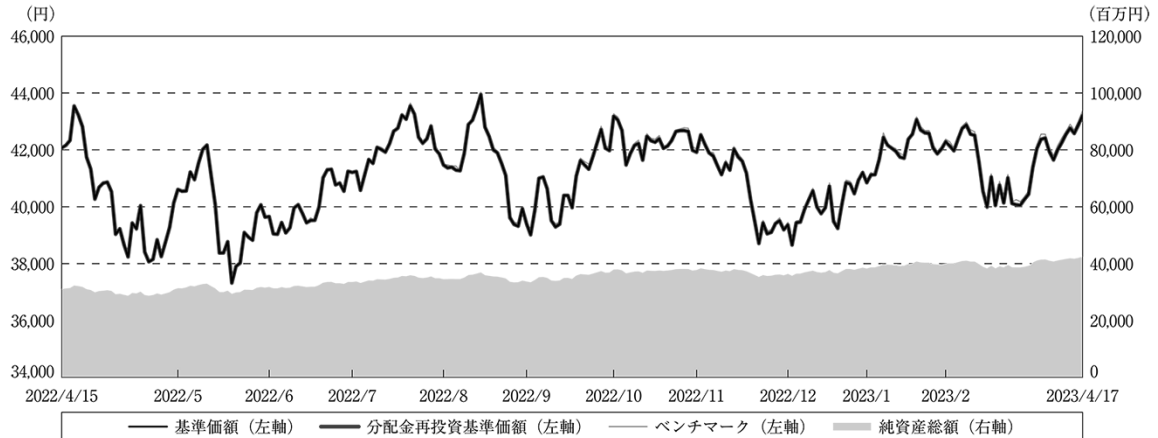
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したものを使用しています。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

## ○運用経過

(2022年4月16日～2023年4月17日)

## ■期中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2022年4月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・期後半、米国のインフレ率が落ち着きを見せ始め、利上げ継続への過度な懸念が後退したこと
- ・為替市場で円安が進行したこと

## マイナス要因

- ・米国で金融引き締めが急速に進み、景気後退への懸念が高まったこと

## ■投資環境

当期の外国株式市場は下落しました。

前半は、2022年4-6月期の企業決算が事前予想ほど悪化しなかったことなどを受けて外国株式市場は上昇する場面があったものの、米国における利上げ継続に対する懸念などから上値の重い展開となりました。

後半に入ると、米国でCPI（消費者物価指数）の上昇が落ち着きを見せたことにより、利上げ継続への過度な懸念が後退したことがプラス要因となった一方、景気後退への懸念が高まったことがマイナス要因となりました。2023年3月には、米国の地銀が経営破綻したことで、金融システム全体に対する懸念が高まり、外国株式市場は下落しましたが、FRB（米連邦準備制度理事会）や米国財務省などが迅速に預金者救済措置を発表したことで金融システムへの不安が和らぎ、期末にかけて上昇しました。

## ■ポートフォリオについて

### <東京海上セレクション・外国株式インデックス>

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、2.7%上昇しました。

### <TMA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コクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標として運用しました。

個別銘柄の選択は、最適化法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しました。その結果、保有銘柄数は前期末の1,048銘柄に対して、当期末には1,054銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、当期、外国株式市場は下落したものの、為替市場で円安が進行したことなどから、基準価額は2.9%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、基準価額の騰落率は+2.7%となり、ベンチマークの騰落率+3.1%にほぼ連動しました。

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>(※)</sup>は、過去1年で0.1%となりました。

(主な差異要因)

### プラス要因

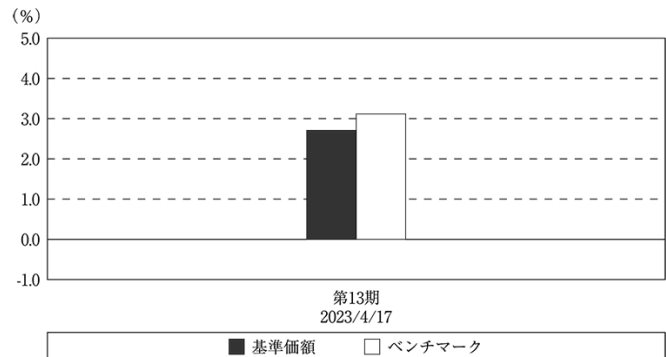
- ・特にありません。

### マイナス要因

- ・信託報酬などのコスト
- ・配当課税の影響

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。ファンドとベンチマークで外貨建資産を円換算する際の為替レートが異なる点を考慮して、トラッキングエラーを算出しています。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）です。

## ■分配金

当期においては、運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

## ◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第13期
	2022年4月16日～ 2023年4月17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	33,206

(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

### <東京海上セレクション・外国株式インデックス>

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

### <TMA外国株式インデックスマザーファンド>

ファンドの基本方針に基づき、外国株式指数先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 4 月16日～2023年 4 月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	91	0.221	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	( 41)	(0.100)	*委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	( 41)	(0.100)	*購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 9)	(0.022)	*運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	7	0.018	(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
（ 株 式 ）	( 6)	(0.014)	*売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 1)	(0.003)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	7	0.018	(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
（ 株 式 ）	( 7)	(0.017)	*有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	12	0.030	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 11)	(0.028)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 1)	(0.002)	*監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0)	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	117	0.287	
期中の平均基準価額は、41,055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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

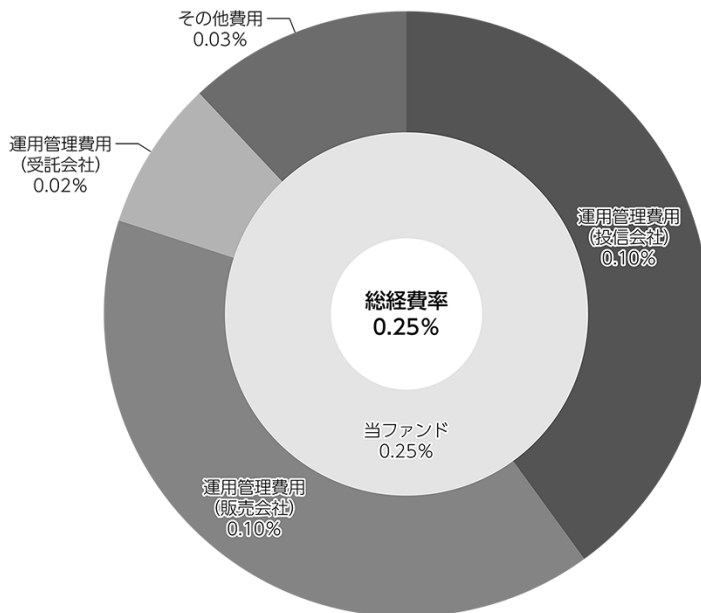
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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、売買委託手数料およ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0.25%です。



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

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

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

## ○売買及び取引の状況

(2022年4月16日～2023年4月17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
TMA外国株式インデックスマザーファンド		3,741,465	15,521,231	1,334,143	5,562,216

## ○株式売買比率

(2022年4月16日～2023年4月17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	
	TMA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	47,907,489千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	95,600,598千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.50	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年4月16日～2023年4月17日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2023年4月17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
		千口	千口	千円
TMA外国株式インデックスマザーファンド		7,274,805	9,682,128	42,508,415



## ○投資信託財産の構成

(2023年4月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	42,508,415	99.8
コール・ローン等、その他	97,539	0.2
投資信託財産総額	42,605,954	100.0

(注) TMA外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(128,912,663千円)の投資信託財産総額(129,367,147千円)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で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=133.89円、1カナダドル=100.15円、1ユーロ=147.00円、1英ポンド=166.04円、1スイスフラン=149.58円、1スウェーデンクローナ=12.96円、1ノルウェークローネ=12.89円、1デンマーククローネ=19.73円、1豪ドル=89.75円、1ニュージーランドドル=83.04円、1香港ドル=17.06円、1シンガポールドル=100.51円、1イスラエルシェケル=36.4415円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年4月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	42,605,954,122
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	42,508,415,232
未収入金	97,538,890
(B) 負債	97,538,890
未払解約金	54,782,179
未払信託報酬	42,424,959
その他未払費用	331,752
(C) 純資産総額(A-B)	42,508,415,232
元本	9,838,527,753
次期繰越損益金	32,669,887,479
(D) 受益権総口数	9,838,527,753口
1万口当たり基準価額(C/D)	43,206円

(注) 当ファンドの期首元本額は7,376,090,613円、期中追加設定元本額は3,797,607,008円、期中一部解約元本額は1,335,169,868円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

## ○損益の状況 (2022年4月16日～2023年4月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	1,614,712,422
売買益	1,837,975,625
売買損	△ 223,263,203
(B) 信託報酬等	△ 79,081,581
(C) 当期損益金(A+B)	1,535,630,841
(D) 前期繰越損益金	6,921,465,707
(E) 追加信託差損益金	24,212,790,931
(配当等相当額)	( 20,629,548,122)
(売買損益相当額)	( 3,583,242,809)
(F) 計(C+D+E)	32,669,887,479
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	32,669,887,479
追加信託差損益金	24,212,790,931
(配当等相当額)	( 20,653,661,119)
(売買損益相当額)	( 3,559,129,812)
分配準備積立金	8,457,096,548

(注) (A) 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) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	656,443,880円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	879,186,961円
c. 信託約款に規定する収益調整金	24,212,790,931円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	6,921,465,707円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	32,669,887,479円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	33,206円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## TMA外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第17期（決算日 2022年11月10日）

（計算期間 2021年11月11日～2022年11月10日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。  
また、一印は組み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	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	期騰落率	中率	期騰落率	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
13期(2018年11月12日)	24,465	4.3	1,147,119	4.9	92.4	5.1	2.3	8,378
14期(2019年11月11日)	26,489	8.3	1,242,639	8.3	95.6	1.7	2.6	14,331
15期(2020年11月10日)	28,804	8.7	1,357,341	9.2	94.8	2.8	2.2	27,743
16期(2021年11月10日)	40,956	42.2	1,931,538	42.3	95.3	2.5	2.2	61,829
17期(2022年11月10日)	42,274	3.2	1,994,363	3.3	95.8	2.1	2.2	104,312

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値（TTM）を用いて計算しているため、基準日前日のMSCIコクサイ指数（米ドルベース）を基準日のTTMで委託会社が円換算したものを使用しています。MSCIコクサイ指数（米ドルベース）とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2021年11月10日	40,956	—	1,931,538	—	95.3	2.5	2.2
11月末	40,447	△1.2	1,907,178	△1.3	93.9	6.1	2.2
12月末	42,140	2.9	1,986,097	2.8	94.5	6.3	2.3
2022年1月末	39,235	△4.2	1,847,458	△4.4	98.1	2.1	2.3
2月末	38,963	△4.9	1,836,612	△4.9	94.7	5.2	2.2
3月末	43,087	5.2	2,031,374	5.2	94.0	6.2	2.3
4月末	41,253	0.7	1,943,470	0.6	94.1	5.6	2.5
5月末	41,184	0.6	1,941,170	0.5	93.5	4.1	2.3
6月末	40,224	△1.8	1,895,745	△1.9	98.0	2.0	2.5
7月末	41,808	2.1	1,967,772	1.9	98.1	1.9	2.5
8月末	42,079	2.7	1,982,293	2.6	95.2	4.8	2.4
9月末	40,003	△2.3	1,883,547	△2.5	98.0	1.9	2.3
10月末	43,830	7.0	2,066,942	7.0	98.1	1.8	2.2
(期 末)							
2022年11月10日	42,274	3.2	1,994,363	3.3	95.8	2.1	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ○運用経過

(2021年11月11日～2022年11月10日)

## ■期中の基準価額等の推移

期首：40,956円

期末：42,274円

騰落率： 3.2%

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・新型コロナウイルス対策に伴う各種行動規制が緩和されたこと
- ・米国の金利引き上げなどにより円安が進行したこと

## マイナス要因

- ・米国で金融引き締めが急速に進んだこと
- ・ウクライナ問題に対する懸念が広がったこと

## ■投資環境

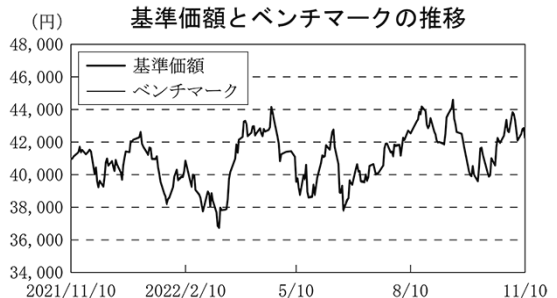
外国株式市場は前期末対比で下落しました。

期初から2021年末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株が確認されたものの重症化するリスクは相対的に低いとの楽観的な見方が広がり、海外株式市場は上昇しました。

2022年に入ると、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締めに積極的な姿勢が確認されたほか、ロシアによるウクライナへの侵攻などを背景に、海外株式市場は下落しました。その後、ウクライナ情勢が落ち着きを見せたことから、海外株式市場は一時的に上昇したものの、FRBが積極的な利上げを行うとの懸念が高まり、再び下落基調となりました。

7月から8月中旬にかけて、2022年4-6月期の企業決算が事前予想ほど悪化しなかったことなどを受けて海外株式市場は上昇したものの、その後は米国における利上げの継続や英国でのトラス政権による大幅減税策に対する懸念が高まり、上値の重い展開となりました。

一方、為替市場では資源価格の高騰などに伴う米国の金利引き上げなどにより円安が進行しました。



(注) ベンチマークは、期首(2021年11月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。

## ■ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標として運用を行いました。

個別銘柄の選択は、最適化法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しました。その結果、保有銘柄数は前期末の1,062銘柄に対して、当期末には1,037銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は3.2%上昇しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、基準価額の騰落率は+3.2%となり、ベンチマークの騰落率+3.3%にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

### プラス要因

- ・特にありません

### マイナス要因

- ・配当課税や売買コストの影響

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>(※)</sup>は、過去1年で0.22%となりました。

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。ファンドとベンチマークで外貨建資産を円換算する際の為替レートが異なる点を考慮して、トラッキングエラーを算出しています。

## ○今後の運用方針

当ファンドの基本方針に基づき、外国株式指数先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年11月11日～2022年11月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 8	% 0.019	(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 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(6)	(0.015)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.003)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	7	0.018	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 * 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(7)	(0.018)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	13	0.031	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
(保 管 費 用)	(12)	(0.030)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	28	0.068	
期中の平均基準価額は、41,187円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(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を乗じたものです。



		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 4,541	千香港ドル 17,317	百株 —	千香港ドル —
	シンガポール	2,436	千シンガポールドル 1,284	— ( —)	千シンガポールドル ( —)
	イスラエル	167	千イスラエルシケル 827	—	千イスラエルシケル —

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ( )内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

## 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	千米ドル	千口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1	250	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	2	726	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.891	193	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	1	116	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.923	132	—	—
	CROWN CASTLE INC	2	464	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1	237	—	—
	DUKE REALTY CORP	2	159	—	—
	EQUINIX INC	(△ 6)	(△ 351)	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	0.574	386	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	1	133	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	2	192	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.504	146	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.993	188	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4	127	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	3	66	—	—
	INVITATION HOMES INC	5	186	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3	51	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.913	161	—	—
	ORION OFFICE REIT INC	—	—	0.332	6
	PROLOGIS INC	( 0.332)	( 6)	—	—
	PUBLIC STORAGE	4	615	—	—
	REALTY INCOME CORP	( 2)	( 351)	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	1	389	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5	352	( —)	( 6)
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.911	58	—	—
	SUN COMMUNITIES INC	0.793	256	—	—
	UDR INC	1	220	—	—
	VENTAS INC	1	193	—	—
	VICI PROPERTIES INC	3	163	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	2	126	—	—
	6	209	—	—	
	4	117	—	—	



銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	WP CAREY INC	1	88	—	—
	WELLTOWER INC	2	225	—	—
	WEYERHAEUSER CO	4	152	—	—
	小 計	80 (△ 2)	7,092 ( 6)	0.332 ( —)	6 ( 6)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4	90	—	—
	小 計	4	90	—	—
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	2	52	— ( —)	— ( 9)
	GECINA SA	1	127	—	—
	COVIVIO	1	94	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.935	50	—	—
	小 計	5	325	— ( —)	— ( 9)
	ユ ー ロ 計	5	325	— ( —)	— ( 9)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	6	28	—	—
	SEGRO PLC	9	85	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	8	47	—	—
小 計	23	162	—	—	
オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル	
MIRVAC GROUP	18	41	—	—	
GPT GROUP	5	21	—	—	
DEXUS/AU	0.627	4	—	—	
GOODMAN GROUP	11	207	—	—	
SCENTRE GROUP	20	55	—	—	
小 計	56	331	—	—	
香港		千香港ドル		千香港ドル	
LINK REIT	10	604	—	—	
小 計	10	604	—	—	
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	39	84	— ( —)	— (0.03672)	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	— ( 2)	— ( 3)	2	3	
小 計	39 ( 2)	84 ( 3)	2 ( —)	3 (0.03672)	

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

(注) ( )内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれていません。

## 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 36,517	百万円 36,089	百万円 -	百万円 -

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）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11月11日～2022年11月10日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	41,015,234千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	76,735,481千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.53

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年11月11日～2022年11月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2022年11月10日現在)

## 外国株式

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	千米ドル	千円	
AFLAC INC	46	81	550	80,547	保険
AES CORPORATION	78	126	331	48,582	公益事業
AT&T INC	660	1,097	2,016	295,282	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	164	269	2,676	391,861	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	164	275	4,067	595,525	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	5	9	360	52,786	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	74	116	837	122,606	メディア・娯楽
ADOBE INC	44	74	2,215	324,374	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	7	10	190	27,906	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	115	259	1,554	227,630	半導体・半導体製造装置
AGILENT TECHNOLOGIES INC	27	46	635	93,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRBNB INC-CLASS A	—	64	615	90,150	消費者サービス
ATR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19	33	933	136,617	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	18	25	228	33,388	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	13	20	609	89,290	素材
ALIGN TECHNOLOGY INC	7	14	250	36,678	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	1	—	—	—	保険
ALLIANT ENERGY CORP	23	46	249	36,517	公益事業
ALLSTATE CORP	21	44	563	82,513	保険
ALLY FINANCIAL INC	—	61	152	22,315	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14	22	452	66,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	26	867	7,579	1,109,766	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	27	928	8,111	1,187,618	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	167	275	1,247	182,669	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	41	1,417	12,213	1,788,158	小売
AMEREN CORPORATION	21	40	332	48,726	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	38	77	679	99,557	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	64	98	1,442	211,225	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10	12	185	27,165	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	84	120	705	103,317	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	18	28	392	57,538	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	18	25	403	59,036	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9	17	550	80,526	各種金融
AMETEK INC	15	30	408	59,857	資本財
AMGEN INC	52	82	2,380	348,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	45	85	633	92,721	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES	49	78	1,161	170,081	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	9	16	375	54,995	ソフトウェア・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	22	36	1,906	279,180	ヘルスケア機器・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	26	—	—	—	各種金融
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	76	464	68,020	各種金融
APPLE INC	1,530	2,499	33,708	4,935,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	84	134	1,269	185,813	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ARAMARK	40	60	217	31,898	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	46	91	847	124,041	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	6	43	529	77,457	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	6	9	114	16,696	保険
ATMOS ENERGY CORP	12	25	259	37,951	公益事業
AUTODESK INC	22	36	708	103,685	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	10	—	—	—	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37	65	1,574	230,485	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	2	3	769	112,595	小売
AVANTOR INC	67	116	228	33,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	8	14	239	35,118	素材
BAKER HUGHES COMPANY	89	164	483	70,861	エネルギー
BALL CORP	30	56	278	40,770	素材
BANK OF AMERICA CORP	714	1,121	4,095	599,691	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	74	117	493	72,184	各種金融
BAXTER INTL INC	44	79	408	59,823	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	26	43	944	138,258	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP	12	40	299	43,917	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	119	196	5,658	828,531	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	24	34	232	34,082	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	2	5	204	30,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	25	35	288	42,217	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	15	24	698	102,257	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	4	8	250	36,668	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	22	27	155	22,731	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	13	23	1,569	229,803	各種金融
BLACKSTONE INC	66	112	1,014	148,473	各種金融
BOEING CO	54	90	1,527	223,705	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	4	6	1,209	177,017	消費者サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	18	24	270	39,548	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	26	54	208	30,571	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	134	224	943	138,167	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	213	328	2,620	383,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10	19	266	39,005	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	37	61	2,904	425,195	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	35	49	277	40,585	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26	46	310	45,427	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	8	13	182	26,790	小売
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12	17	215	31,563	各種金融
CBRE GROUP INC - A	33	49	350	51,255	不動産
CDW CORP/DE	13	21	374	54,876	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	23	37	391	57,339	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10	21	194	28,494	運輸
CIGNA CORP	31	49	1,595	233,531	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	33	54	931	136,421	各種金融
CMS ENERGY CORP	24	50	282	41,320	公益事業
CSX CORP	191	328	967	141,709	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	116	201	2,006	293,703	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
COTERRA ENERGY INC	—	154	413	60,498	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	29	45	674	98,778	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	21	39	201	29,470	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45	59	606	88,810	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	33	51	413	60,578	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	20	34	220	32,300	小売
CARLYLE GROUP INC/THE	25	51	133	19,588	各種金融
CARRIER GLOBAL CORP	79	129	520	76,272	資本財
CATALENT INC	21	32	136	19,940	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	51	82	1,868	273,515	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	10	17	157	23,051	素材
CENTENE CORP	59	92	779	114,101	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	65	122	345	50,547	公益事業
CERNER CORP	17	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CHARLES RIVER LABORATORIES	6	10	232	33,988	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11	18	650	95,177	メディア・娯楽
CHENIERE ENERGY INC	—	39	646	94,715	エネルギー
CHEVRONTEXACO CORP	171	290	5,165	756,252	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	3	4	635	93,062	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	24	40	291	42,699	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15	26	266	38,945	保険
CISCO SYSTEMS INC	373	621	2,728	399,521	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	7	13	569	83,327	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	190	294	1,335	195,489	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42	87	346	50,744	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	15	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	14	22	316	46,355	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	18	52	197	28,975	ソフトウェア・サービス
COCA-COLA COMPANY	362	625	3,673	537,790	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	19	31	146	21,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46	69	375	55,039	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	64	111	821	120,222	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	419	680	2,134	312,538	メディア・娯楽
CONAGRA BRANDS INC	49	85	303	44,367	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	130	221	2,777	406,692	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	29	53	466	68,299	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15	25	599	87,769	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	4	9	248	36,328	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	21	65	365	53,566	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10	19	251	36,791	ソフトウェア・サービス
CORNING INC	71	121	390	57,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	65	108	726	106,325	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	39	68	3,377	494,551	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	40	65	521	76,285	商業・専門サービス
COUPA SOFTWARE INC	9	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A	19	36	450	65,962	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	13	28	205	30,029	素材
CUMMINS INC	11	20	495	72,523	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DR HORTON INC	33	53	405	59,334	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	17	33	369	54,151	公益事業
DANAHER CORP	60	108	2,667	390,484	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARDEN RESTAURANTS INC	17	26	364	53,364	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	—	47	321	47,003	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	9	15	102	15,018	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	28	45	1,810	265,050	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	28	48	191	28,089	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	24	39	112	16,465	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	70	121	811	118,738	エネルギー
DEXCOM INC	10	67	765	112,021	ヘルスケア機器・サービス
THE WALT DISNEY CO	170	284	2,470	361,726	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32	44	445	65,163	各種金融
DISCOVERY INC-A	41	—	—	—	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	30	—	—	—	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORPORATION	26	80	113	16,644	メディア・娯楽
EVEREST RE GROUP LTD	3	6	220	32,331	保険
DOCUSIGN INC	20	47	188	27,544	ソフトウェア・サービス
Dollar General Corp	22	35	857	125,577	小売
DOLLAR TREE INC	25	36	558	81,837	小売
DOMINION ENERGY INC	73	123	743	108,815	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	4	6	211	30,978	消費者サービス
DOVER CORP	12	18	236	34,620	資本財
DOW INC	69	104	495	72,607	素材
DUKE ENERGY CORP	64	111	1,041	152,486	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	53	75	502	73,623	素材
DYNATRACE INC	26	55	188	27,538	ソフトウェア・サービス
EOG RESOURCES INC	60	104	1,459	213,657	エネルギー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6	—	—	—	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34	53	306	44,825	保険
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	14	21	168	24,663	素材
EBAY INC	63	86	351	51,510	小売
ECOLAB INC	20	37	532	77,901	素材
BUNGE LIMITED	16	25	252	37,030	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	39	68	392	57,392	公益事業
Edwards Lifesciences Corp	58	102	715	104,788	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	26	42	535	78,416	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	48	83	750	109,843	資本財
ENPHASE ENERGY INC	12	23	661	96,846	半導体・半導体製造装置
ENTERGY CORP	21	34	370	54,249	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	6	10	323	47,329	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	12	22	364	53,427	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	54	70	206	30,210	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	33	54	238	34,938	公益事業
ETSY INC	14	26	248	36,384	小売
EVERGY INC	27	42	256	37,503	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	32	51	388	56,866	公益事業
EXELON CORP	75	155	584	85,636	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	千米ドル	千円	
EXPEDIA GROUP INC	17	31	279	40,943	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	12	26	274	40,193	運輸
EXXON MOBIL CORPORATION	389	657	7,164	1,048,895	エネルギー
FMC CORP	13	18	238	34,922	素材
META PLATFORMS INC-A	221	354	3,594	526,341	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2	6	289	42,429	各種金融
FAIR ISAAC CORP	4	4	205	30,147	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	39	82	404	59,205	資本財
FEDEX CORP	23	38	613	89,777	運輸
F5 INC	6	10	145	21,247	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	62	95	589	86,343	ソフトウェア・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	26	47	185	27,095	保険
FIFTH THIRD BANCORP	74	114	393	57,600	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14	33	377	55,331	銀行
FISERV INC	61	97	941	137,817	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	56	91	340	49,873	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7	12	217	31,782	ソフトウェア・サービス
FORD MOTOR CO	383	642	854	125,131	自動車・自動車部品
FORTINET INC	15	116	580	84,998	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	26	53	346	50,679	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	16	26	151	22,243	資本財
FOX CORP-CLASS A	32	32	92	13,590	メディア・娯楽
FOX CORP-CLASS B	31	64	171	25,082	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	36	54	124	18,265	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	153	272	928	135,923	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18	33	635	93,100	保険
GARTNER INC	9	13	443	64,886	ソフトウェア・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	7	14	137	20,117	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	20	35	889	130,237	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	104	174	1,451	212,448	資本財
GENERAL MILLS INC	51	93	748	109,568	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	122	223	851	124,720	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	15	21	387	56,725	小売
GILEAD SCIENCES INC	113	190	1,570	229,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	31	45	437	64,093	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	8	16	189	27,671	保険
GODADDY INC - CLASS A	25	27	186	27,372	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30	52	1,917	280,690	各種金融
WW GRAINGER INC	3	6	392	57,455	資本財
HCA HEALTHCARE INC	24	36	772	113,163	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	119	161	448	65,721	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	81	155	573	84,036	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	32	42	305	44,682	保険
HASBRO INC	15	21	125	18,397	耐久消費財・アパレル
HEICO CORP	12	19	243	35,671	資本財
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6	11	205	30,158	ソフトウェア・サービス
HERSHEY CO/THE	11	21	487	71,342	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	33	54	754	110,407	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	148	215	304	44,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	30	51	664	97,272	消費者サービス
HOME DEPOT INC	97	157	4,525	662,618	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	61	100	2,101	307,715	資本財
HORMEL FOODS CORP	28	52	246	36,103	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	51	77	279	40,968	資本財
HUBSPOT INC	—	10	264	38,732	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	11	19	1,059	155,098	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8	15	264	38,701	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	172	269	403	59,078	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3	7	188	27,584	資本財
IAC INC	12	27	119	17,477	メディア・娯楽
IDEX CORP	7	11	260	38,089	資本財
IDEX LABORATORIES INC	8	13	527	77,253	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	25	44	933	136,605	資本財
ILLUMINA INC	14	25	559	81,882	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	27	34	268	39,253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	50	82	427	62,567	資本財
INTEL CORP	370	613	1,689	247,308	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48	84	818	119,799	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	81	137	1,895	277,550	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	24	41	380	55,764	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	32	55	185	27,120	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	52	75	226	33,134	メディア・娯楽
INTUIT INC	26	43	1,594	233,482	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	34	58	1,371	200,758	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	18	30	632	92,640	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	276	452	5,869	859,306	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	15	—	—	—	商業・専門サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	—	21	256	37,614	商業・専門サービス
JOHNSON & JOHNSON	236	399	6,883	1,007,790	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	27	51	149	21,863	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	15	23	808	118,401	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC	55	100	506	74,210	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	10	—	—	—	運輸
KELLOGG CO	26	39	279	40,894	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	86	126	473	69,395	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	88	167	300	43,928	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16	28	465	68,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	26	48	604	88,546	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	165	321	564	82,650	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	18	31	147	21,565	運輸
KRAFT HEINZ CO/THE	64	116	441	64,598	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	70	110	532	78,006	食品・生活必需品小売り
KYNDRYL HOLDINGS INC-W/I	16	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LKQ CORP	34	43	228	33,506	小売
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19	30	736	107,836	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8	14	322	47,254	ヘルスケア機器・サービス



銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LAM RESEARCH CORP	13	21	940	137,675	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	22	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	50	74	298	43,751	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21	37	763	111,728	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	7	16	219	32,139	自動車・自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	15	21	226	33,168	商業・専門サービス
LENNAR CORP-CL A	29	43	344	50,416	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	3	6	152	22,279	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	18	27	217	31,873	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	26	43	185	27,096	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	76	125	4,574	669,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	25	38	125	18,321	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	20	36	1,785	261,409	資本財
LOEWS CORP	27	42	229	33,608	保険
LOWE'S COMPANIES	66	98	1,832	268,244	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	12	18	609	89,165	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	8	30	509	74,537	銀行
MSCI INC	7	13	621	91,049	各種金融
MARATHON PETROLEUM CORP	63	85	994	145,577	エネルギー
MARKEL CORP	1	2	272	39,855	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4	6	170	24,896	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	44	74	1,191	174,421	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	30	48	720	105,507	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6	11	380	55,676	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC	85	148	545	79,798	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	20	38	175	25,703	資本財
MASIMO CORP	6	12	141	20,649	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	82	133	4,220	617,912	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	28	—	—	—	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	24	39	315	46,260	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	71	112	3,114	455,924	消費者サービス
MCKESSON CORP	14	23	913	133,732	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	4	7	717	105,005	小売
MERCK & CO. INC.	232	388	3,947	577,995	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	62	98	714	104,667	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	2	3	475	69,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	658	1,097	24,641	3,607,702	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	56	89	593	86,925	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	108	174	975	142,864	半導体・半導体製造装置
MODERNA INC	33	55	907	132,859	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	6	10	92	13,494	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	6	10	328	48,038	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	27	35	176	25,877	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	116	198	1,259	184,393	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	—	13	185	27,208	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5	8	287	42,085	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	29	61	590	86,506	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	14	25	660	96,727	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MORGAN STANLEY	128	204	1,706	249,844	各種金融
MOSAIC CO/THE	43	72	358	52,550	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14	25	648	94,947	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	29	40	174	25,520	公益事業
NVR INC	0.37	0.53	215	31,597	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	10	60	385	56,391	各種金融
NETAPP INC	22	35	239	35,010	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	41	70	1,795	262,857	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	15	20	247	36,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	26	33	156	22,959	資本財
NEWELL BRANDS INC	39	82	103	15,173	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	67	119	515	75,543	素材
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	61	75	122	17,908	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	180	309	2,419	354,205	公益事業
NIKE INC -CL B	115	195	1,800	263,605	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	45	87	216	31,766	公益事業
NORDSON CORP	5	7	158	23,221	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	22	36	837	122,592	運輸
NORTHERN TRUST CORP	20	35	301	44,200	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	12	23	1,244	182,263	資本財
GEN DIGITAL INC	60	99	227	33,308	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	29	44	581	85,165	素材
NVIDIA CORP	231	390	5,382	788,100	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6	10	853	124,969	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	—	154	1,048	153,441	エネルギー
OKTA INC	14	36	163	23,987	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	8	16	463	67,843	運輸
OMNICOM GROUP	21	33	246	36,142	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	76	487	71,426	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	46	73	448	65,643	エネルギー
ORACLE CORPORATION	172	246	1,868	273,544	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	34	58	424	62,137	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36	62	973	142,474	銀行
PPG INDUSTRIES INC	19	36	411	60,298	素材
PPL CORPORATION	77	113	302	44,304	公益事業
PTC INC	15	21	264	38,761	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	32	49	496	72,649	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	7	16	195	28,640	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	10	49	753	110,335	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	11	19	550	80,542	資本財
PAYCHEX INC	24	48	555	81,307	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	6	10	323	47,315	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	105	176	1,387	203,077	ソフトウェア・サービス
PELTON INTERACTIVE INC-A	31	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PEPSICO INC	122	209	3,736	547,063	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	12	22	289	42,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	515	865	4,041	591,745	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	137	235	2,138	313,101	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PHILLIPS 66	44	74	780	114,283	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	14	—	—	—	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	65	122	260	38,194	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	24	41	997	145,996	エネルギー
POOL CORP	4	7	226	33,118	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	18	34	370	54,201	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	32	47	427	62,522	保険
PROCTER & GAMBLE CO	219	365	4,986	730,123	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	50	92	1,179	172,625	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39	54	554	81,229	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	35	78	448	65,704	公益事業
PULTE HOMES INC	29	40	155	22,774	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	11	17	147	21,578	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	98	170	1,888	276,425	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC	—	26	379	55,518	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	11	17	261	38,281	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	10	23	218	32,058	素材
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	20	34	422	61,808	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	145	229	2,186	320,162	資本財
Regeneron Pharmaceuticals Inc	10	17	1,278	187,202	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	92	166	373	54,751	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	16	32	427	62,533	商業・専門サービス
RESMED INC	14	23	495	72,617	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	13	18	135	19,769	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	9	19	484	70,986	資本財
ROKU INC	12	30	147	21,652	メディア・娯楽
ROLLINS INC	28	46	193	28,378	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	9	15	632	92,561	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	38	58	536	78,589	小売
S&P GLOBAL INC	21	53	1,665	243,917	各種金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	7	7	42	6,159	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27	40	197	28,934	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	5	12	254	37,328	銀行
SALESFORCE INC	91	157	2,234	327,147	ソフトウェア・サービス
HENRY SCHEIN INC	—	25	186	27,243	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	147	224	1,188	174,063	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	141	232	1,820	266,513	各種金融
SEA LTD-ADR	—	59	244	35,736	メディア・娯楽
SEAGEN INC	16	26	365	53,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	15	28	130	19,165	素材
SEMPRA ENERGY	27	50	760	111,330	公益事業
SERVICENOW INC	19	33	1,211	177,352	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	22	38	860	126,046	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14	24	208	30,474	半導体・半導体製造装置
SMITH (A. O.) CORP	12	25	138	20,302	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	10	18	267	39,165	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	5	7	180	26,365	資本財

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SNAP INC - A	100	—	—	—	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19	37	477	69,876	ソフトウェア・サービス
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	6	10	260	38,093	半導体・半導体製造装置
SOUTHERN CO	85	163	1,035	151,667	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	28	60	224	32,874	運輸
SPLUNK INC	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BLOCK INC-A	38	96	550	80,569	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	15	27	201	29,500	資本財
STARBUCKS CORP	114	181	1,664	243,733	消費者サービス
STATE STREET CORP	34	59	447	65,549	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	25	35	328	48,072	素材
STRYKER CORP	30	53	1,099	160,932	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	16	25	729	106,771	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	60	86	301	44,179	各種金融
SYSCO CORP	50	77	642	94,084	食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	118	181	1,273	186,524	小売
T-MOBILE US INC	62	101	1,502	219,908	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	13	27	261	38,213	メディア・娯楽
TARGET CORP	45	72	1,111	162,775	小売
TELADOC HEALTH INC	17	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5	7	320	46,885	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	5	9	182	26,735	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	17	27	234	34,290	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	75	411	7,299	1,068,743	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS	80	137	2,272	332,654	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	27	37	253	37,169	資本財
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	49	79	318	46,623	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	36	60	2,949	431,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	50	80	1,001	146,653	資本財
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13	18	374	54,824	小売
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	23	135	19,783	各種金融
TRANSDIGM GROUP INC	5	8	488	71,589	資本財
TRANSUNION	19	36	200	29,341	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	18	33	613	89,846	保険
TRIMBLE INC	28	44	238	34,977	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUIST FINANCIAL CORP	129	210	896	131,261	銀行
TWILIO INC - A	16	37	163	23,976	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	85	—	—	—	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	5	8	261	38,222	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	28	40	259	38,061	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	20	43	154	22,551	公益事業
US BANCORP	140	213	922	135,104	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	126	251	667	97,719	運輸
ULTA BEAUTY INC	6	8	351	51,455	小売
UNION PACIFIC CORP	59	96	1,961	287,121	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	65	112	1,838	269,230	運輸
UNITED RENTALS INC	8	13	421	61,767	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	84	143	7,743	1,133,780	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6	10	115	16,841	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	34	56	153	22,441	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	5	9	207	30,355	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	44	66	851	124,642	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14	23	393	57,548	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	11	14	249	36,550	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	365	631	2,374	347,595	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	12	23	404	59,192	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26	41	1,286	188,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS-B	73	105	163	23,985	メディア・娯楽
VIATRIS INC	134	210	227	33,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	154	253	4,906	718,407	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	22	32	357	52,399	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	12	—	—	—	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	12	23	401	58,744	素材
WEC ENERGY GROUP INC	29	47	426	62,410	公益事業
WABTEC CORP/DE	23	33	325	47,617	資本財
WALMART INC	136	231	3,231	473,106	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	71	111	411	60,232	食品・生活必需品小売り
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	394	387	56,791	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	18	39	539	78,972	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	34	61	978	143,326	商業・専門サービス
WATERS CORP	5	9	289	42,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	—	27	79	11,571	小売
WELLS FARGO & COMPANY	387	588	2,706	396,229	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	8	13	301	44,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP	34	55	191	28,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	43	65	82	12,068	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	31	54	188	27,590	素材
WHIRLPOOL CORP	6	10	145	21,363	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	105	190	622	91,153	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	19	35	482	70,595	ソフトウェア・サービス
XCEL ENERGY INC	45	82	542	79,402	公益事業
XILINX INC	24	—	—	—	半導体・半導体製造装置
XYLEM INC	17	33	354	51,902	資本財
YUM! BRANDS INC	28	38	466	68,332	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5	9	212	31,158	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19	31	338	49,492	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	44	71	948	138,899	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	22	42	304	44,533	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	52	87	139	20,449	各種金融
CHUBB LTD	37	63	1,326	194,180	保険
LyondellBasell Industries NV	26	37	302	44,306	素材
GARMIN LTD	11	22	194	28,542	耐久消費財・アパレル
ACCENTURE PLC-CL A	57	97	2,590	379,211	ソフトウェア・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	26	40	627	91,833	半導体・半導体製造装置
TE CONNECTIVITY LTD	28	45	514	75,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APTIV PLC	28	49	484	70,896	自動車・自動車部品

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
EATON CORP PLC		33	59	928	135,930	資本財
IHS MARKIT LTD		36	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		11	14	333	48,785	保険
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		19	39	160	23,566	資本財
ALLEGION PLC		8	13	142	20,858	資本財
STERIS PLC		10	18	301	44,097	ヘルスケア機器・サービス
AMCOR PLC		148	239	263	38,612	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC		22	36	599	87,702	資本財
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS		22	34	175	25,731	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AON PLC		20	32	913	133,674	保険
PENTAIR PLC		14	26	105	15,516	資本財
ROYALTY PHARMA PLC-CL A		—	51	221	32,495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CYBERARK SOFTWARE LTD		—	5	72	10,648	ソフトウェア・サービス
MEDTRONIC PLC		120	197	1,563	228,845	ヘルスケア機器・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		59	104	665	97,493	資本財
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC		25	41	203	29,763	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC		47	77	2,423	354,854	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		18	—	—	—	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	28,135	50,654	499,862	73,184,896	
	銘 柄 数 < 比 率 >	522	516	—	< 70.2% >	
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		30	81	485	52,491	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		100	185	273	29,564	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC		—	133	820	88,827	食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC		80	—	—	—	食品・生活必需品小売り
BCE INC		19	31	190	20,617	電気通信サービス
BANK OF MONTREAL		59	100	1,271	137,560	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		100	168	1,115	120,690	銀行
BARRICK GOLD CORP		169	268	556	60,205	素材
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		129	232	1,274	137,937	各種金融
CAE INC		46	89	214	23,222	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B		17	36	219	23,798	素材
CGI INC		18	33	368	39,880	ソフトウェア・サービス
CAMECO CORP		63	87	277	30,078	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		38	133	820	88,802	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO		67	91	1,483	160,517	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES		122	211	1,682	182,057	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		62	151	1,547	167,407	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A		8	9	139	15,063	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A		34	50	176	19,147	公益事業
CENOVUS ENERGY INC		186	269	730	79,070	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		2	3	665	71,966	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC		31	55	432	46,806	小売
EMERA INC		27	61	304	32,983	公益事業
ENBRIDGE INC		187	307	1,633	176,774	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		2	4	326	35,301	保険
FORTIS INC		42	77	409	44,264	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP		19	28	501	54,241	素材

銘柄	株数	当期期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	32	48	175	19,026	耐久消費財・アパレル	
GREAT-WEST LIFE CO INC	28	44	134	14,559	保険	
HYDRO ONE LTD	40	72	244	26,437	公益事業	
IGM FINANCIAL INC	20	48	179	19,428	各種金融	
IMPERIAL OIL LTD	46	61	456	49,437	エネルギー	
INTACT FINANCIAL CORP	17	30	600	64,943	保険	
KEYERA CORP	46	60	169	18,288	エネルギー	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	35	—	—	—	素材	
LOBLAW COMPANIES LTD	15	33	383	41,510	食品・生活必需品小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30	58	435	47,119	自動車・自動車部品	
MANULIFE FINANCIAL CORP	170	256	570	61,717	保険	
METRO INC	22	46	336	36,428	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	34	56	532	57,640	銀行	
NUTRIEN LTD	58	94	949	102,771	素材	
OPEN TEXT CORP	35	64	240	26,016	ソフトウェア・サービス	
PEMBINA PIPELINE CORP	63	101	451	48,875	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	61	101	325	35,202	保険	
RESTAURANT BRANDS INTERN	38	57	467	50,539	消費者サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	41	68	398	43,071	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	123	213	2,735	295,997	銀行	
SAPUTO INC	49	71	234	25,417	食品・飲料・タバコ	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	58	78	279	30,267	メディア・娯楽	
SHOPIFY INC - CLASS A	10	207	865	93,694	ソフトウェア・サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	40	69	410	44,386	保険	
SUNCOR ENERGY INC	165	228	1,066	115,426	エネルギー	
TC ENERGY CORP	88	150	930	100,674	エネルギー	
TELUS CORP	16	16	45	4,939	電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	18	30	436	47,196	商業・専門サービス	
TORONTO-DOMINION BANK	159	274	2,407	260,454	銀行	
WSP GLOBAL INC	16	24	397	42,997	資本財	
WESTON (GEORGE) LTD	11	16	252	27,289	食品・生活必需品小売り	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	56	95	459	49,721	素材	
小計	株数・金額	3,324	5,687	35,496	3,840,758	
	銘柄数<比率>	58	57	—	<3.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG	17	26	332	48,783	耐久消費財・アパレル	
Fresenius SE & CO KG	37	58	136	20,040	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	23	58	113	16,665	電気通信サービス	
HANNOVER RUECK SE	4	9	162	23,791	保険	
GEA GROUP AG	26	29	113	16,606	資本財	
CONTINENTAL AG	9	26	148	21,838	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE POST AG	83	141	504	74,021	運輸	
MERCK KGAA	12	21	366	53,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE AG	70	112	442	64,882	公益事業	
SAP SE	95	156	1,539	225,731	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	213	361	314	46,058	公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	10	16	102	14,967	家庭用品・パーソナル用品	
PUMA AG	9	24	110	16,185	耐久消費財・アパレル	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等		
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
BAYER AG	94	149	753	110,478	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	10	23	150	22,141	家庭用品・パーソナル用品		
BASF SE	74	125	596	87,489	素材		
BEIERSDORF AG	8	19	191	28,109	家庭用品・パーソナル用品		
HEIDELBERGCEMENT AG	13	16	80	11,864	素材		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	17	35	100	14,761	ヘルスケア機器・サービス		
ALLIANZ SE	34	55	1,040	152,637	保険		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11	20	586	85,992	保険		
VOLKSWAGEN AG	4	7	129	18,980	自動車・自動車部品		
VOLKSWAGEN AG PFD	15	25	349	51,199	自動車・自動車部品		
MERCEDES-BENZ GROUP AG	76	121	729	107,036	自動車・自動車部品		
SIEMENS AG	73	117	1,358	199,246	資本財		
DEUTSCHE BANK AG -REG	211	358	347	51,020	各種金融		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30	52	418	61,318	自動車・自動車部品		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	293	493	972	142,651	電気通信サービス		
SARTORIUS AG-VORZUG	3	5	209	30,788	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	130	202	562	82,521	半導体・半導体製造装置		
DEUTSCHE BOERSE AG	15	28	464	68,196	各種金融		
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	16	25	144	21,123	自動車・自動車部品		
LANXESS	15	—	—	—	素材		
MTU AERO ENGINES AG	6	9	174	25,612	資本財		
SYMRISE AG	10	22	237	34,880	素材		
BRENNTAG SE	14	24	160	23,561	資本財		
EVONIK INDUSTRIES AG	11	53	99	14,635	素材		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	262	534	126	18,544	電気通信サービス		
COMMERZBANK AG	181	266	204	29,960	銀行		
LEG IMMOBILIEN SE	6	13	92	13,520	不動産		
VONOVIA SE	49	117	274	40,213	不動産		
SIEMENS HEALTHINEERS AG	29	52	254	37,332	ヘルスケア機器・サービス		
TEAMVIEWER AG	59	—	—	—	ソフトウェア・サービス		
SIEMENS ENERGY AG	57	106	137	20,183	資本財		
FUCHS PETROLUB SE-PREF	9	—	—	—	素材		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	80	225	33,110	資本財		
ZALANDO SE	28	59	153	22,493	小売		
SCOUT24 SE	18	23	122	17,971	メディア・娯楽		
COVESTRO AG	15	29	103	15,168	素材		
HELLOFRESH SE	—	47	107	15,720	食品・生活必需品小売り		
UNIPER SE	22	—	—	—	公益事業		
DELIVERY HERO SE	20	—	—	—	小売		
小 計	株 数	金 額	2,569	4,369	16,049	2,353,820	
銘 柄 数 < 比 率 >	50	47	—	< 2.3% >			
(ユーロ…イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI	68	123	201	29,492	保険		
INTESA SANPAOLO	1,488	2,593	558	81,935	銀行		
MEDIOBANCA SPA	80	121	118	17,397	銀行		
ENEL SPA	765	1,064	513	75,268	公益事業		
ENI SPA	180	413	579	84,997	エネルギー		
SNAM SPA	250	250	118	17,346	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		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	151	256	182	26,734	公益事業	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	21	33	135	19,877	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Prysmian SpA	32	49	160	23,526	資本財	
MONCLER SPA	22	41	195	28,723	耐久消費財・アパレル	
FINECOBANK SPA	71	138	198	29,072	銀行	
UNICREDIT SPA	234	365	469	68,843	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	95	180	168	24,767	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,462	5,633	3,600	527,983	
	銘柄 数 < 比 率 >	13	13	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	22	22	67	9,837	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73	117	282	41,381	公益事業	
L'OREAL	21	36	1,204	176,580	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	25	42	2,808	411,871	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	9	19	240	35,217	資本財	
CAPGEMINI	17	26	442	64,928	ソフトウェア・サービス	
PUBLICIS GROUPE	20	39	242	35,552	メディア・娯楽	
MICHELIN (CGDE)-B	10	—	—	—	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	16	30	555	81,507	食品・飲料・タバコ	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47	82	1,109	162,672	資本財	
VIVENDI SA	52	77	64	9,459	メディア・娯楽	
ORANGE	125	236	230	33,794	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	2	5	688	100,914	耐久消費財・アパレル	
KERING	7	11	568	83,382	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	42	—	—	—	保険	
CARREFOUR SA	52	101	167	24,622	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	21	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	96	170	1,479	216,918	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SOCIETE GENERALE-A	86	142	334	49,041	銀行	
TELEPERFORMANCE	5	9	262	38,494	商業・専門サービス	
SODEXO	16	19	176	25,886	消費者サービス	
AXA SA	151	267	708	103,893	保険	
ESSILORLUXOTTICA	27	46	766	112,477	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT AGRICOLE SA	124	180	175	25,725	銀行	
BNP PARIBAS	103	167	843	123,650	銀行	
ORPEA	9	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	45	72	307	45,142	資本財	
Wendel	5	16	137	20,206	各種金融	
SAFRAN SA	34	54	625	91,805	資本財	
ENGIE	163	279	374	54,851	公益事業	
ALSTOM	47	74	170	24,989	資本財	
ELECTRICITE DE FRANCE	90	161	191	28,110	公益事業	
Legrand SA	17	37	287	42,177	資本財	
Eiffage SA	8	12	117	17,232	資本財	
TOTALENERGIES SE	214	373	2,118	310,701	エネルギー	
Aeroports de Paris	8	11	161	23,681	運輸	
UBISOFT ENTERTAINMENT	20	32	82	12,149	メディア・娯楽	
SCOR SE	30	—	—	—	保険	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VINCI S.A.	48	75	709	103,992	資本財	
DANONE	54	85	425	62,469	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE	39	75	1,019	149,509	素材	
Bureau Veritas SA	23	45	118	17,386	商業・専門サービス	
GETLINK SE	65	105	171	25,212	運輸	
SUEZ	42	—	—	—	公益事業	
EDENRED	25	45	245	35,934	ソフトウェア・サービス	
VALEO SA	38	80	138	20,291	自動車・自動車部品	
DASSAULT SYSTEMES SE	74	111	377	55,334	ソフトウェア・サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	16	26	177	26,049	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WORLDLINE SA	31	48	210	30,798	ソフトウェア・サービス	
MICHELIN (CGDE)	—	106	279	41,064	自動車・自動車部品	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3	6	206	30,281	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	2,340	3,795	22,072	3,237,184	
	銘柄 数 < 比 率 >	50	45	—	< 3.1% >	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE	56	90	1,030	151,061	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	6	8	209	30,791	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	13	19	101	14,898	商業・専門サービス	
WOLTERS KLUWER	17	38	389	57,100	商業・専門サービス	
Koninklijke Vopak NV	5	—	—	—	エネルギー	
AEGON NV	232	406	193	28,330	保険	
KONIKLIJKE KPN NV	359	544	153	22,479	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	63	102	339	49,790	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	79	150	193	28,367	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	22	40	345	50,645	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	10	15	107	15,816	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	13	26	323	47,458	素材	
ASML HOLDING NV	39	63	3,140	460,590	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	73	140	409	60,101	食品・生活必需品小売り	
FERRARI NV	11	20	418	61,419	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	130	192	276	40,499	資本財	
AKZO NOBEL	13	26	173	25,511	素材	
PROSUS NV	93	137	667	97,957	小売	
STELLANTIS NV	190	339	464	68,195	自動車・自動車部品	
EXOR NV	—	16	116	17,018	各種金融	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83	154	143	21,002	食品・飲料・タバコ	
NN GROUP NV	26	41	180	26,405	保険	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	79	128	259	38,012	メディア・娯楽	
EXOR NV	10	—	—	—	各種金融	
QIAGEN N V	24	43	193	28,405	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV /WI	2	3	502	73,713	ソフトウェア・サービス	
ING GROEP NV-CVA	396	612	673	98,750	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,055	3,366	11,007	1,614,324	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	25	—	< 1.5% >	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA	37	50	89	13,053	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	603	984	520	76,372	銀行	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株		千ユーロ	千円	
NATURGY ENERGY GROUP SA	30	54	139	20,501	20,501	公益事業
REPSOL SA	128	259	361	53,075	53,075	エネルギー
BANCO SANTANDER S.A	1,547	2,499	652	95,768	95,768	銀行
TELEFONICA SA	468	862	311	45,669	45,669	電気通信サービス
ENAGAS SA	48	74	124	18,314	18,314	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	44	44	115	17,011	17,011	資本財
FERROVIAL SA	53	80	190	27,982	27,982	資本財
CaixaBank SA	385	884	289	42,455	42,455	銀行
IBERDROLA SA	529	868	891	130,731	130,731	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	47	71	362	53,219	53,219	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA	25	57	96	14,114	14,114	公益事業
FERROVIAL SA-RTS	53	—	—	—	—	資本財
FERROVIAL SA-RTS	—	80	3	486	486	資本財
INDITEX	101	162	395	57,956	57,956	小売
AENA SME SA	7	12	153	22,486	22,486	運輸
CELLNEX TELECOM SAU	58	105	361	53,048	53,048	電気通信サービス
GRIFOLS SA	43	—	—	—	—	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	4,215	7,152	5,061	742,249	
	銘柄数<比率>	18	17	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	29	50	255	37,489	37,489	銀行
SOLVAY SA	8	17	170	25,065	25,065	素材
UCB SA	14	23	178	26,222	26,222	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA	6	—	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8	18	141	20,685	20,685	各種金融
AGEAS	21	35	128	18,815	18,815	保険
UMICORE	22	44	153	22,481	22,481	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	73	136	711	104,341	104,341	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	186	326	1,739	255,102	
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.2%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	24	38	190	27,870	27,870	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	40	77	219	32,248	32,248	銀行
小計	株数・金額	64	116	409	60,118	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA	95	125	204	29,957	29,957	エネルギー
AROUNDTOWN SA	191	485	105	15,516	15,516	不動産
ARCELORMITTAL	67	97	234	34,340	34,340	素材
小計	株数・金額	354	707	544	79,815	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS	41	49	105	15,494	15,494	食品・生活必需品小売り
WARTSILA	84	154	115	16,993	16,993	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	40	80	284	41,779	41,779	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	46	80	114	16,729	16,729	素材
SAMPO OYJ-A SHS	42	58	279	40,957	40,957	保険
FORTUM OYJ	52	129	190	27,960	27,960	公益事業

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ELISA OYJ	12	12	59	8,706		電気通信サービス
NOKIA OYJ	535	770	342	50,276		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	37	74	341	50,121		エネルギー
KONE OYJ-B	27	44	200	29,402		資本財
ORION OYJ	19	30	147	21,615		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	939	1,484	2,182	320,039	
	銘柄 数 < 比 率 >	11	11	—	< 0.3% >	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC(DUBLIN)	56	94	341	50,112		素材
KINGSPAN GROUP PLC	13	26	147	21,637		資本財
KERRY GROUP PLC-A	12	22	200	29,362		食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25	40	137	20,209		素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	18	29	384	56,417		消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	127	213	1,211	177,738	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	307	504	223	32,735		公益事業
Galp Energia SGPS SA	89	157	174	25,525		エネルギー
JERONIMO MARTINS	50	61	129	19,026		食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	447	724	526	77,287	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	16,764	27,890	64,405	9,445,663	
	銘柄 数 < 比 率 >	189	178	—	< 9.1% >	
(イギリス)			千英ポンド			
ASHTAD GROUP PLC	46	73	356	59,347		資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	90	250	97	16,247		耐久消費財・アパレル
AVIVA PLC	324	—	—	—		保険
DIAGEO PLC	199	342	1,242	206,871		食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	22	—	—	—		各種金融
DCC PLC	17	17	77	12,884		資本財
BAE SYSTEMS PLC	230	506	405	67,565		資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	192	324	1,100	183,204		食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	35	70	156	25,990		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	249	466	262	43,742		銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	77	136	294	49,012		食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	1,858	3,102	1,479	246,234		銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682	954	225	37,545		保険
Associated British Foods PLC	46	65	98	16,451		食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC	29	44	57	9,572		耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	256	432	390	65,040		保険
RIO TINTO PLC	103	179	918	152,903		素材
ST JAMES'S PLACE PLC	69	126	136	22,684		各種金融
SSE PLC	100	175	282	47,097		公益事業
BP PLC	1,854	2,818	1,358	226,180		エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,352	10,560	449	74,829		銀行
SMITH & NEPHEW PLC	80	139	143	23,833		ヘルスケア機器・サービス
GSK PLC	424	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASTRAZENECA PLC	144	240	2,603	433,382		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
BT GROUP PLC	940	1,172	135	22,607	電気通信サービス
BARCLAYS PLC	1,524	2,477	382	63,688	銀行
INTERTEK GROUP PLC	14	22	85	14,304	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	38	71	141	23,508	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	14	20	109	18,279	小売
KINGFISHER PLC	245	309	69	11,649	小売
ADMIRAL GROUP PLC	24	52	103	17,232	保険
SHELL PLC	346	—	—	—	エネルギー
SHELL PLC	358	—	—	—	エネルギー
BUNZL PLC	27	52	155	25,859	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	221	427	231	38,490	商業・専門サービス
London Stock Exchange Group PLC	33	52	412	68,702	各種金融
UNILEVER PLC	233	388	1,581	263,228	家庭用品・パーソナル用品
EXPERIAN PLC	82	137	379	63,252	商業・専門サービス
MONDI PLC	36	84	131	21,818	素材
SEVERN TRENT PLC	24	50	134	22,313	公益事業
Whitbread PLC	34	60	152	25,341	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35	155	128	21,406	各種金融
SMITHS GROUP PLC	52	52	84	14,064	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	133	223	683	113,849	素材
3I GROUP PLC	96	115	145	24,168	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	72	110	627	104,453	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	153	267	620	103,311	商業・専門サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	66	140	138	23,009	公益事業
OCADO GROUP PLC	74	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GLENCORE PLC	1,038	1,686	860	143,282	素材
NATWEST GROUP PLC	600	—	—	—	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	83	173	127	21,284	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	133	189	154	25,768	メディア・娯楽
COMPASS GROUP PLC	199	286	532	88,660	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	292	528	520	86,728	公益事業
ABRDN PLC	192	605	108	18,107	各種金融
BHP GROUP PLC	179	—	—	—	素材
VODAFONE GROUP PLC	2,616	3,954	411	68,527	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	27	42	198	33,089	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	12	25	170	28,373	素材
FERGUSON PLC	17	29	290	48,281	資本財
M&G PLC	415	636	113	18,851	各種金融
TESCO PLC	567	1,068	243	40,600	食品・生活必需品小売り
NATWEST GROUP PLC	—	956	226	37,752	銀行
INFORMA PLC	218	298	164	27,363	メディア・娯楽
HALEON PLC	—	944	270	45,014	家庭用品・パーソナル用品
GSK PLC	—	603	848	141,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MELROSE INDUSTRIES PLC	623	1,089	132	22,058	資本財
SHELL PLC-NEW	—	1,086	2,589	431,027	エネルギー
SCHRODERS PLC	—	223	93	15,556	各種金融
AVIVA PLC	—	518	220	36,778	保険
AUTO TRADER GROUP PLC	97	144	79	13,307	メディア・娯楽

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7	14	158	26,401	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	266	—	—	—	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	19	54	111	18,559	素材
小 計	25,981	42,634	27,403	4,561,796	
	銘柄数 < 比率 >	69	66	—	< 4.4% >
(スイス)			千スイスフラン		
SGS SA	0.43	0.78	175	26,089	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.4	0.54	104	15,498	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	2	3	167	24,946	電気通信サービス
Lindt & Spruengli AG	0.15	0.24	235	34,995	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	97	14,566	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	0.79	1	436	64,896	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12	21	921	137,073	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	194	313	2,562	381,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	162	227	653	97,284	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	66	112	3,671	546,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG(REG)	21	32	106	15,778	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	34	81	387	57,724	素材
CLARIANT AG-REG	31	83	136	20,310	素材
NESTLE SA-REGISTERED	258	425	4,643	690,937	食品・飲料・タバコ
Baloise Holding AG	4	8	121	18,130	保険
TEMENOS GROUP AG-REG	10	20	120	17,961	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG	5	10	234	34,931	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG	262	583	233	34,754	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B	4	6	151	22,534	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	7	12	608	90,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	3	5	264	39,422	保険
SWISS PRIME SITE	6	14	119	17,824	不動産
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2	3	347	51,766	各種金融
Schindler Holding AG	1	3	65	9,702	資本財
Schindler Holding AG	4	10	170	25,428	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6	9	216	32,173	運輸
Logitech International SA	21	31	167	24,916	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEBERIT AG-REG	2	4	217	32,385	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	28	42	215	32,044	各種金融
SWISS RE AG	25	43	335	49,971	保険
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	51	83	864	128,636	耐久消費財・アパレル
SIKA AG-REG	13	23	553	82,413	素材
ALCON INC	50	81	465	69,298	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	23	231	34,413	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG	312	556	909	135,397	各種金融
小 計	1,611	2,882	20,917	3,112,319	
	銘柄数 < 比率 >	35	35	—	< 3.0% >
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	138	250	2,951	39,752	銀行
Swedbank AB	68	132	2,179	29,356	銀行
SECURITAS AB-B SHS	62	158	1,434	19,329	商業・専門サービス

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
HENNES & MAURITZ AB-B	87	126	1,493	20,115	小売	
ERICSSON LM-B SHS	271	457	2,757	37,143	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA COMPANY AB	259	502	1,475	19,870	電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	32	75	1,330	17,924	資本財	
ORRON ENERGY AB	37	—	—	—	エネルギー	
ALFA LAVAL AB	34	57	1,656	22,313	資本財	
Husqvarna AB	79	207	1,525	20,555	資本財	
SKF AB-B SHARES	38	68	1,205	16,242	資本財	
VOLVO AB-B SHS	136	234	4,418	59,513	資本財	
SANDVIK AB	90	162	3,048	41,066	資本財	
Industrivarden AB	2	58	1,490	20,083	各種金融	
Industrivarden AB	29	67	1,714	23,090	各種金融	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	63	112	1,558	20,992	素材	
TELE2 AB-B SHS	76	169	1,547	20,851	電気通信サービス	
ATLAS COPCO AB-A SHS	51	—	—	—	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	42	—	—	—	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	55	97	2,315	31,183	家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	39	72	1,594	21,471	各種金融	
EVOLUTION AB	19	32	3,254	43,834	消費者サービス	
BOLIDEN AB	—	73	2,595	34,959	素材	
ATLAS COPCO AB-A SHS	—	292	3,661	49,324	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	—	377	4,242	57,150	資本財	
EPIROC AB-A	67	81	1,483	19,984	資本財	
EPIROC AB-B	39	98	1,562	21,040	資本財	
INVESTOR AB-B SHS	135	301	5,548	74,736	各種金融	
BOLIDEN AB	32	—	—	—	素材	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	180	286	2,633	35,471	資本財	
KINNEVIK AB-B	33	104	1,534	20,668	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	164	284	3,200	43,115	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SWEDISH MATCH AB	169	270	3,136	42,253	食品・飲料・タバコ	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	136	231	2,403	32,373	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	80	133	3,053	41,125	資本財	
NORDEA BANK ABP	253	459	4,880	65,737	銀行	
小計	株数・金額	3,011	6,041	78,888	1,062,632	
	銘柄数<比率>	33	32	—	<1.0%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
TELENOR ASA	51	128	1,223	17,256	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	80	154	5,786	81,590	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	9	30	1,422	20,063	素材	
MOWI ASA	49	86	1,343	18,943	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	202	337	2,324	32,769	素材	
AKER BP ASA	—	72	2,574	36,307	エネルギー	
ORKLA ASA	56	88	601	8,481	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	34	63	1,220	17,214	保険	
DNB BANK ASA	78	162	2,967	41,848	銀行	
SCHIBSTED ASA-B SHS	20	—	—	—	メディア・娯楽	
小計	株数・金額	582	1,124	19,466	274,475	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.3%>	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	9	16	1,490	29,393	食品・飲料・タバコ	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.61	0.74	1,121	22,108	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.32	0.55	809	15,954	運輸	
DANSKE BANK A/S	57	98	1,209	23,848	銀行	
GENMAB A/S	7	11	3,398	67,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV A/S	21	30	3,202	63,153	運輸	
PANDORA A/S	8	14	673	13,282	耐久消費財・アパレル	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	14	19	847	16,711	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	18	31	1,229	24,246	素材	
COLOPLAST-B	10	19	1,672	32,988	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	151	255	21,697	427,882	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	109	170	2,848	56,179	資本財	
TRYG A/S	36	52	878	17,322	保険	
ORSTED A/S	22	33	2,135	42,102	公益事業	
DEMANT A/S	22	45	869	17,149	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額	491	800	44,083	869,336	
	銘柄数<比率>	15	15	-	<0.8%>	
(オーストラリア)			千豪ドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	28	36	214	20,200	ヘルスケア機器・サービス	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	226	422	1,037	97,644	銀行	
WESTPAC BANKING CORPORATION	307	519	1,233	116,072	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	175	301	515	48,567	素材	
TELSTRA GROUP LTD	356	492	193	18,202	電気通信サービス	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	17	31	220	20,731	各種金融	
BHP GROUP LIMITED	263	796	3,278	308,605	素材	
COMPUTERSHARE LIMITED	100	115	299	28,208	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	42	74	2,077	195,528	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	309	469	639	60,224	運輸	
COCHLEAR LIMITED	8	13	261	24,616	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	366	489	284	26,751	公益事業	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	157	258	2,709	255,090	銀行	
RIO TINTO LIMITED	33	61	609	57,403	素材	
APA GROUP	190	256	274	25,841	公益事業	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	73	102	379	35,736	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	225	415	206	19,445	保険	
ORICA LTD	86	140	211	19,947	素材	
LENLEASE GROUP	128	238	191	18,008	不動産	
BLUESCOPE STEEL LTD	53	90	148	13,936	素材	
SUNCORP GROUP LTD	109	216	258	24,287	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	280	485	1,538	144,796	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	73	161	314	29,565	素材	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	151	251	324	30,528	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	186	248	249	23,485	素材	
SANTOS LTD	189	680	519	48,906	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	46	66	215	20,278	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	394	-	-	-	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	89	152	703	66,250	小売	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	81	-	-	-	エネルギー	



銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円		
WOOLWORTHS GROUP LTD	104	145	483	45,473	食品・生活必需品小売り	
SEEK LTD	60	108	226	21,329	メディア・娯楽	
BRAMBLES LTD	107	257	297	28,035	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	31	56	966	90,957	各種金融	
EVOLUTION MINING LTD	348	716	168	15,850	素材	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	42	80	228	21,488	素材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	132	159	203	19,142	食品・飲料・タバコ	
XERO LTD	18	35	260	24,560	ソフトウェア・サービス	
AFTERPAY LTD	27	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
AMPOL LTD	48	66	184	17,365	エネルギー	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	—	318	1,240	116,758	エネルギー	
LOTTERY CORP LTD/THE	—	433	196	18,538	消費者サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	237	327	228	21,544	食品・生活必需品小売り	
SOUTH32 LTD	597	1,015	397	37,456	素材	
COLES GROUP LTD	111	190	314	29,627	食品・生活必需品小売り	
小 計	株数・金額	6,620	11,502	24,508	2,306,994	
	銘柄数<比率>	43	42	—	<2.2%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
RYMAN HEALTHCARE LTD	61	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	184	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	62	99	194	16,763	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	346	389	200	17,272	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229	252	189	16,294	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	212	422	191	16,534	公益事業	
小 計	株数・金額	1,096	1,163	775	66,864	
	銘柄数<比率>	6	4	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
CLP HOLDINGS LIMITED	105	215	1,179	21,993	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	122	200	5,200	96,980	各種金融	
MTR CORPORATION	160	175	626	11,684	運輸	
HANG SENG BANK	56	108	1,232	22,982	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	314	414	896	16,717	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	105	105	396	7,402	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	985	1,465	929	17,332	公益事業	
Galaxy Entertainment Group Limited	330	560	2,408	44,909	消費者サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	320	595	1,523	28,407	銀行	
SINO LAND CO	698	1,198	1,079	20,130	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	120	155	1,315	24,528	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	125	205	1,149	21,429	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	160	255	2,110	39,353	資本財	
AIA GROUP LTD	1,146	1,902	12,943	241,389	保険	
HKT Trust / HKT Ltd	780	1,070	946	17,660	電気通信サービス	
Sands China Ltd	576	872	1,496	27,906	消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	206	600	968	18,060	不動産	
WH Group Limited	1,660	2,125	905	16,882	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228	333	1,386	25,857	資本財	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	115	200	760	14,174	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	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED		193	293	1,322	24,668	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	8,505	13,046	40,774	760,450	
	銘 柄 数 < 比 率 >	21	21	—	<0.7%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		294	698	234	24,498	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD		168	261	904	94,524	銀行
CITY DEVELOPMENTS		169	230	179	18,764	不動産
UNITED OVERSEAS BANK		89	165	480	50,225	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD		119	268	172	17,972	不動産
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,081	1,533	390	40,834	電気通信サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		226	421	515	53,872	銀行
KEPPEL CORP LTD		306	438	310	32,393	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		1,792	2,666	215	22,557	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	4,244	6,680	3,404	355,644	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOALIM BM		117	177	608	25,042	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		102	202	694	28,593	銀行
ICL GROUP LTD		139	139	413	17,023	素材
NICE LTD		7	8	515	21,224	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		30	30	397	16,369	銀行
AZRIELI GROUP LTD		—	6	151	6,252	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	396	563	2,780	114,505	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	6	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	100,767	170,671	—	99,956,339	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1,014	990	—	<95.8%>	

(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で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

## 外国投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		比 率	
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千口	千口	千米ドル	千円	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC		1	2	403	59,142	0.1
AMERICAN TOWER CORP		4	7	1,443	211,308	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1	1	310	45,458	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		1	2	191	28,040	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		0.864	1	195	28,614	0.0
CROWN CASTLE INC		4	6	869	127,367	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC		2	4	456	66,767	0.1
DUKE REALTY CORP		3	—	—	—	—
EQUINIX INC		0.887	1	873	127,904	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC		1	3	201	29,537	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		2	5	327	47,952	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.568	1	222	32,542	0.0

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数		評 価		比 率	
	口 数	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	%	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	2	336	49,239	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5	9	238	34,960	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	10	14	240	35,200	0.0	
INVITATION HOMES INC	5	11	329	48,297	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8	11	131	19,206	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.969	1	286	41,954	0.0	
PROLOGIS INC	6	14	1,579	231,194	0.2	
PUBLIC STORAGE	1	2	691	101,209	0.1	
REALTY INCOME CORP	3	8	542	79,454	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	2	3	186	27,370	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1	1	504	73,890	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3	5	579	84,878	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	1	2	325	47,682	0.0	
UDR INC	3	6	247	36,184	0.0	
VENTAS INC	4	6	289	42,409	0.0	
VICI PROPERTIES INC	8	14	472	69,143	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	3	7	163	24,008	0.0	
WP CAREY INC	1	2	229	33,660	0.0	
WELLTOWER INC	4	7	478	70,052	0.1	
WEYERHAEUSER CO	6	11	336	49,195	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	108	185	13,686	2,003,829	
	銘柄 数 < 比 率 >	32	31	—	< 1.9% >	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4	8	176	19,148	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	4	8	176	19,148	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	3	6	128	18,900	0.0	
GECINA SA	0.267	1	128	18,870	0.0	
COVIVIO	0.894	2	138	20,354	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	2	123	18,094	0.0	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	6	12	519	76,220	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND CO PLC	16	22	85	14,161	0.0	
SEGRO PLC	9	18	146	24,348	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	10	18	113	18,839	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	36	59	344	57,350	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	39	58	122	11,539	0.0	
GPT GROUP	17	23	101	9,568	0.0	
STOCKLAND	24	24	87	8,204	0.0	
DEXUS/AU	7	7	60	5,729	0.0	
GOODMAN GROUP	15	26	457	43,063	0.0	
SCENTRE GROUP	50	70	205	19,368	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	155	211	1,035	97,474	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.1% >	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港) LINK REIT	千口 18	千口 29	千香港ドル 1,459	千円 27,212	% 0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1 1	29 1	1,459 —	27,212 <0.0%>	
(シンガポール) CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	87	127	千シンガポールドル 242	25,325	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	87 1	127 1	242 —	25,325 <0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	418 48	635 47	— —	2,306,560 <2.2%>	

(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で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引	1,622	—
S&P 500 EMIN	317	—
DJ EU STX 50	230	—
FTSE 100 IDX	—	—

(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で邦貨換算したものです。

### ○投資信託財産の構成

(2022年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 99,956,339	% 95.8
投資証券	2,306,560	2.2
コール・ローン等、その他	2,103,849	2.0
投資信託財産総額	104,366,748	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(104,079,680千円)の投資信託財産総額(104,366,748千円)に対する比率は99.7%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で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=146.41円、1カナダドル=108.20円、1ユーロ=146.66円、1英ポンド=166.47円、1スイスフラン=148.79円、1スウェーデンクローナ=13.47円、1ノルウェークローネ=14.10円、1デンマーククローネ=19.72円、1豪ドル=94.13円、1ニュージーランドドル=86.18円、1香港ドル=18.65円、1シンガポールドル=104.46円、1イスラエルシェケル=41.1882円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月10日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	104,542,264,717	
コール・ローン等	1,195,543,545	
株式(評価額)	99,956,339,109	
投資証券(評価額)	2,306,560,596	
未収入金	240,049,548	
未収配当金	86,281,289	
差入委託証拠金	757,490,630	
(B) 負債	229,535,797	
未払金	182,054,310	
未払解約金	47,480,862	
未払利息	625	
(C) 純資産総額(A-B)	104,312,728,920	
元本	24,675,436,542	
次期繰越損益金	79,637,292,378	
(D) 受益権総口数	24,675,436,542口	
1万円当たり基準価額(C/D)	42,274円	

(注) 当親ファンドの期首元本額は15,096,651,804円、期中追加設定元本額は11,652,889,813円、期中一部解約元本額は2,074,105,075円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・外国株式インデックス2<適格機関投資家限定>	11,890,692,343円
東京海上セレクション・外国株式インデックス	8,699,797,201円
先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	2,115,899,328円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	1,400,256,639円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	178,671,399円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	113,619,891円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	94,993,008円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	67,928,940円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	60,313,587円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	38,347,137円
TMA外国株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	14,917,069円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

## ○損益の状況 (2021年11月11日~2022年11月10日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	1,567,207,721	
受取配当金	1,551,475,151	
受取利息	3,922,524	
その他収益金	11,932,746	
支払利息	△ 122,700	
(B) 有価証券売買損益	2,330,358,214	
売買益	24,375,237,484	
売買損	△22,044,879,270	
(C) 先物取引等取引損益	△ 689,388,843	
取引益	670,499,862	
取引損	△ 1,359,888,705	
(D) 保管費用等	△ 27,471,721	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,180,705,371	
(F) 前期繰越損益金	46,732,772,008	
(G) 追加信託差損益金	36,221,213,317	
(H) 解約差損益金	△ 6,497,398,318	
(I) 計(E+F+G+H)	79,637,292,378	
次期繰越損益金(I)	79,637,292,378	

(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です。

(注) (H)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。