

# ダイワつみたて インデックス外国株式

## 運用報告書(全体版)

### 第 6 期

(決算日 2023年11月30日)

(作成対象期間 2022年12月 1 日～2023年11月30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。

当ファンドは、外国の株式に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00～17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

#### ★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（設定日：2018年8月16日）                                                                                                              |                        |     |
| 運用方針   | 投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                              |                        |     |
| 主要投資対象 | ベビーファンド                                                                                                                          | 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券 |     |
|        | 外国株式インデックスマザーファンド                                                                                                                | 外国の株式（預託証券を含みます。）      |     |
| 組入制限   | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                            |                        | 無制限 |
|        | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                 |                        | 無制限 |
| 分配方針   | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 |                        |     |

最近5期の運用実績

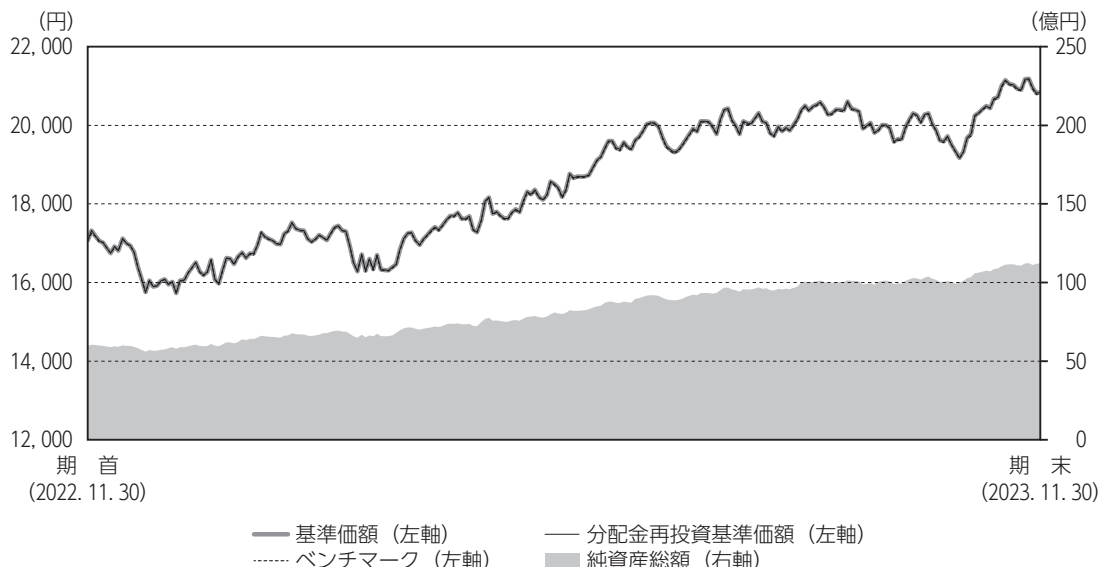
| 決 算 期               | 基 準 価 額 |            |            | MSCIコクサイ指数<br>(税引後配当込み、円ベース) |            | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総 額 |
|---------------------|---------|------------|------------|------------------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|
|                     | (分配落)   | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 | (ベンチマーク)                     | 期 中<br>騰落率 |             |             |              |            |
|                     | 円       | 円          | %          |                              | %          | %           | %           | %            | 百万円        |
| 2 期末 (2019年12月 2 日) | 10,889  | 0          | 11.6       | 10,871                       | 11.6       | 90.5        | 6.7         | 2.7          | 374        |
| 3 期末 (2020年11月30日)  | 11,910  | 0          | 9.4        | 11,884                       | 9.3        | 93.3        | 4.7         | 2.3          | 1,358      |
| 4 期末 (2021年11月30日)  | 16,280  | 0          | 36.7       | 16,229                       | 36.6       | 91.4        | 6.5         | 2.2          | 3,335      |
| 5 期末 (2022年11月30日)  | 17,070  | 0          | 4.9        | 17,001                       | 4.8        | 89.7        | 8.1         | 2.2          | 5,964      |
| 6 期末 (2023年11月30日)  | 20,838  | 0          | 22.1       | 20,728                       | 21.9       | 89.8        | 8.2         | 1.9          | 11,223     |

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCI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。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>]
- (注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注 5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
- (注 7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。
- ※ベンチマークを「MSCIコクサイ指数 (円ベース)」から「MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース)」に変更しました。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \* 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。
- \* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \* ベンチマークはMSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）です。  
 ※ベンチマークを「MSCIコクサイ指数（円ベース）」から「MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）」に変更しました。

### 基準価額・騰落率

期 首：17,070円

期 末：20,838円（分配金0円）

騰落率：22.1%（分配金込み）

### 基準価額の主な変動要因

海外株式市況が上昇したことや、為替相場が円安になったことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワつみたてインデックス外国株式

| 年 月 日            | 基 準 価 額 |       | MSCIコクサイ指数<br>(税引後配当込み、円ベース) |       | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 投資証券<br>組入比率 |
|------------------|---------|-------|------------------------------|-------|-------------|-------------|--------------|
|                  |         | 騰 落 率 | (ベンチマーク)                     | 騰 落 率 |             |             |              |
| (期首) 2022年11月30日 | 円       | %     |                              | %     | %           | %           | %            |
|                  | 17,070  | —     | 17,001                       | —     | 89.7        | 8.1         | 2.2          |
| 12月末             | 16,020  | △ 6.2 | 15,949                       | △ 6.2 | 91.3        | 6.4         | 2.2          |
| 2023年 1 月末       | 16,623  | △ 2.6 | 16,560                       | △ 2.6 | 90.1        | 7.6         | 2.3          |
| 2 月末             | 17,206  | 0.8   | 17,122                       | 0.7   | 93.0        | 5.0         | 2.2          |
| 3 月末             | 17,119  | 0.3   | 17,033                       | 0.2   | 92.4        | 5.6         | 2.1          |
| 4 月末             | 17,587  | 3.0   | 17,488                       | 2.9   | 92.1        | 5.7         | 2.1          |
| 5 月末             | 18,404  | 7.8   | 18,309                       | 7.7   | 91.8        | 6.4         | 2.0          |
| 6 月末             | 19,848  | 16.3  | 19,755                       | 16.2  | 92.8        | 5.1         | 2.0          |
| 7 月末             | 20,148  | 18.0  | 20,054                       | 18.0  | 91.9        | 6.3         | 2.0          |
| 8 月末             | 20,498  | 20.1  | 20,394                       | 20.0  | 90.3        | 7.8         | 1.9          |
| 9 月末             | 20,001  | 17.2  | 19,897                       | 17.0  | 92.2        | 6.0         | 1.9          |
| 10月末             | 19,326  | 13.2  | 19,229                       | 13.1  | 90.7        | 7.6         | 1.9          |
| (期末) 2023年11月30日 | 20,838  | 22.1  | 20,728                       | 21.9  | 89.8        | 8.2         | 1.9          |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2022. 12. 1 ~ 2023. 11. 30)

### ■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから、2022年末にかけて下落しました。2023年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）が今後利上げ幅を縮小させるのではないかと期待を背景に上昇しました。2月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、3月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。経営破綻した米国の地方銀行の預金保護やF R Bによる金融機関への流動性供給、スイスの金融大手の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、3月下旬には上昇に転じました。その後レンジでの推移をはさみ、6月以降は、米国の債務上限問題の解決や米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から、欧米株ともに上昇しました。8月以降は、米国で堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招いたことや、欧州で弱い経済指標が欧州経済への先行き懸念を強めたことから、下落しました。11月に入ると、米国の利上げ打ち止め観測などを背景に米国金利の下落傾向が続き、上昇しました。

### ■為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高米ドル安となりました。その後2023年2月には、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が上昇したことで円安に転じましたが、3月に入り、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりなどから、円高となりました。4月以降は、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、米ドルなどの通貨は対円で上昇（円安）しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

今後の運用にあたりまして、引き続き、「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れることで、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ってまいります。

### ■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりまして、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、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ってまいります。

ポートフォリオについて

(2022. 12. 1 ~ 2023. 11. 30)

■当ファンド

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れました。

■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に組み入れ、S & P 500先物取引等の株価指数先物も一部利用し、株式組入比率（投資信託証券、株価指数先物を含む。）につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

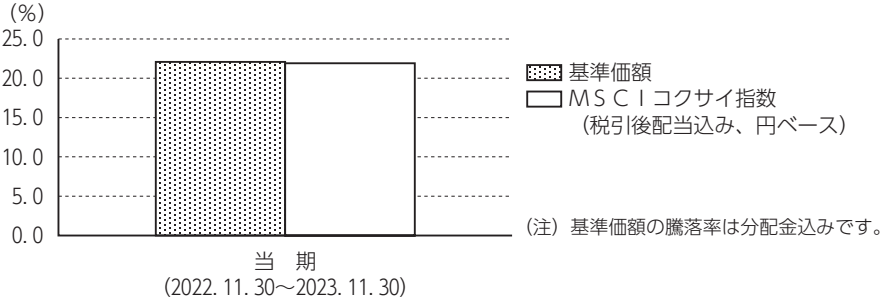
| 組入ファンド            | ベンチマーク                       |
|-------------------|------------------------------|
| 外国株式インデックスマザーファンド | M S C I コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース） |

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は21.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.1%となりました。

マザーファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、運用管理費用、売買コスト等がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\* ベンチマークはM S C I コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目        | 当 期                        |        |
|------------|----------------------------|--------|
|            | 2022年12月1日<br>～2023年11月30日 |        |
| 当期分配金（税込み） | (円)                        | —      |
| 対基準価額比率    | (%)                        | —      |
| 当期の収益      | (円)                        | —      |
| 当期の収益以外    | (円)                        | —      |
| 翌期繰越分配対象額  | (円)                        | 10,838 |

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れることで、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ってまいります。

### ■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、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ってまいります。

1万口当りの費用の明細

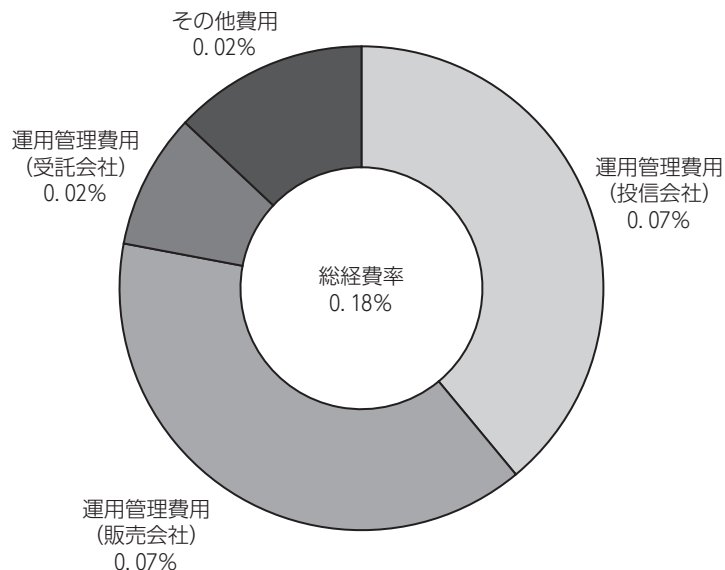
| 項 目        | 当 期<br>(2022. 12. 1～2023. 11. 30) |          | 項 目 の 概 要                                                               |
|------------|-----------------------------------|----------|-------------------------------------------------------------------------|
|            | 金 額                               | 比 率      |                                                                         |
| 信 託 報 酬    | 28円                               | 0. 154 % | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は18, 514円です。                     |
| (投 信 会 社)  | (13)                              | (0. 069) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価                       |
| (販 売 会 社)  | (13)                              | (0. 069) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                         |
| (受 託 会 社)  | (3)                               | (0. 016) | 受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                                          |
| 売買委託手数料    | 1                                 | 0. 004   | 売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数<br>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)      | (0)                               | (0. 002) |                                                                         |
| (先物・オプション) | (0)                               | (0. 001) |                                                                         |
| (投 資 証 券)  | (0)                               | (0. 000) |                                                                         |
| 有価証券取引税    | 1                                 | 0. 005   | 有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (株 式)      | (1)                               | (0. 005) |                                                                         |
| (投 資 証 券)  | (0)                               | (0. 000) |                                                                         |
| そ の 他 費 用  | 4                                 | 0. 023   | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数                                         |
| (保 管 費 用)  | (3)                               | (0. 017) | 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および資金の送金・資産の移転等に要する費用                      |
| (監 査 費 用)  | (1)                               | (0. 005) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                             |
| (そ の 他)    | (0)                               | (0. 000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                      |
| 合 計        | 34                                | 0. 185   |                                                                         |

- (注 1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。
- (注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- (注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。
- (注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## 参考情報

## ■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.18%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

ダイワつみたてインデックス外国株式

■売買および取引の状況  
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年12月 1 日から2023年11月30日まで)

|                           | 設 定      |             | 解 約     |          |
|---------------------------|----------|-------------|---------|----------|
|                           | □ 数      | 金 額         | □ 数     | 金 額      |
|                           | 千口       | 千円          | 千口      | 千円       |
| 外国株式<br>インデックス<br>マザーファンド | 787, 199 | 3, 690, 436 | 42, 526 | 195, 142 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合  
(2022年12月 1 日から2023年11月30日まで)

| 項 目                 | 当 期               |
|---------------------|-------------------|
|                     | 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       | 51, 216, 680千円    |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 321, 507, 110千円   |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0. 15             |

(注 1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                   | 期 首         | 当 期 末       |              |
|-----------------------|-------------|-------------|--------------|
|                       | □ 数         | □ 数         | 評 価 額        |
|                       | 千口          | 千口          | 千円           |
| 外国株式インデックス<br>マザーファンド | 1, 381, 872 | 2, 126, 545 | 11, 221, 993 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

| 項 目                   | 当 期 末        |        |
|-----------------------|--------------|--------|
|                       | 評 価 額        | 比 率    |
|                       | 千円           | %      |
| 外国株式インデックス<br>マザーファンド | 11, 221, 993 | 99. 9  |
| コール・ローン等、その他          | 11, 989      | 0. 1   |
| 投資信託財産総額              | 11, 233, 983 | 100. 0 |

(注 1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注 2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝147. 07円、1カナダ・ドル＝108. 21円、1オーストラリア・ドル＝97. 45円、1香港・ドル＝18. 84円、1シンガポール・ドル＝110. 38円、1ニュージーランド・ドル＝90. 70円、1イギリス・ポンド＝186. 84円、1イスラエル・シェケル＝39. 913円、1スイス・フラン＝168. 56円、1デンマーク・クローネ＝21. 66円、1ノルウェー・クローネ＝13. 81円、1スウェーデン・クローネ＝14. 21円、1ユーロ＝161. 51円です。

(注 3) 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 (394, 774, 332千円) の投資信託財産総額 (416, 412, 657千円) に対する比率は、94. 8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

| 項 目                         | 当 期 末              |
|-----------------------------|--------------------|
| (A) 資産                      | 11, 233, 983, 736円 |
| コール・ローン等                    | 11, 989, 872       |
| 外国株式インデックス<br>マザーファンド (評価額) | 11, 221, 993, 864  |
| (B) 負債                      | 10, 868, 768       |
| 未払解約金                       | 3, 118, 837        |
| 未払信託報酬                      | 7, 482, 771        |
| その他未払費用                     | 267, 160           |
| (C) 純資産総額 (A－B)             | 11, 223, 114, 968  |
| 元本                          | 5, 385, 869, 431   |
| 次期繰越損益金                     | 5, 837, 245, 537   |
| (D) 受益権総口数                  | 5, 385, 869, 431口  |
| 1 万口当り基準価額 (C / D)          | 20, 838円           |

\* 期首における元本額は3, 494, 206, 618円、当作成期間中における追加設定元本額は2, 298, 603, 181円、同解約元本額は406, 940, 368円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は20, 838円です。

■損益の状況

当期 自 2022年12月 1 日 至 2023年11月30日

| 項 目                   | 当 期              |
|-----------------------|------------------|
| (A) 配当等収益             | △ 2,650円         |
| 受取利息                  | 94               |
| 支払利息                  | △ 2,744          |
| (B) 有価証券売買損益          | 1,705,448,388    |
| 売買益                   | 1,768,353,177    |
| 売買損                   | △ 62,904,789     |
| (C) 信託報酬等             | △ 13,064,125     |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 1,692,381,613    |
| (E) 前期繰越損益金           | 791,253,524      |
| (F) 追加信託差損益金          | 3,353,610,400    |
| (配当等相当額)              | ( 2,306,498,413) |
| (売買損益相当額)             | ( 1,047,111,987) |
| (G) 合計 (D + E + F)    | 5,837,245,537    |
| 次期繰越損益金 (G)           | 5,837,245,537    |
| 追加信託差損益金              | 3,353,610,400    |
| (配当等相当額)              | ( 2,306,498,413) |
| (売買損益相当額)             | ( 1,047,111,987) |
| 分配準備積立金               | 2,483,637,787    |
| 繰越損益金                 | △ 2,650          |

- (注1) 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おります。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目                         | 当 期            |
|-----------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益             | 0円             |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益         | 1,692,382,876  |
| (c) 収益調整金                   | 3,353,610,400  |
| (d) 分配準備積立金                 | 791,254,911    |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 5,837,248,187  |
| (f) 分配金                     | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)       | 5,837,248,187  |
| (h) 受益権総口数                  | 5,385,869,431口 |

《お知らせ》

■ベンチマークの変更について

当ファンドおよびマザーファンドにおいてベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：MSCIコクサイ指数（円ベース）

変更後：MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）

# 外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第24期（決算日 2023年11月30日）

（作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日）

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

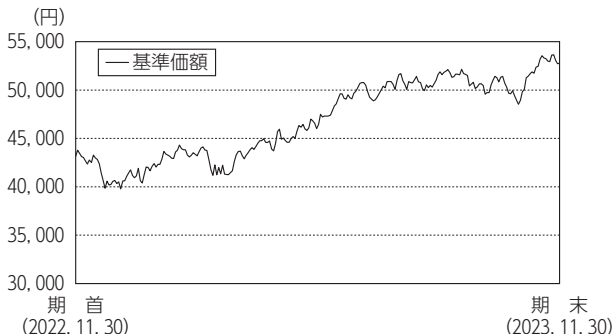
|        |                                                            |
|--------|------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 |
| 主要投資対象 | 外国の株式（預託証券を含みます。）                                          |
| 株式組入制限 | 無制限                                                        |

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



| 年 月 日            | 基準価額   |       | MSCIコクサイ指数<br>(税引後配当込み、円ベース) |       | 株 式  | 株 式  | 投資証券 |
|------------------|--------|-------|------------------------------|-------|------|------|------|
|                  | 円      | 騰落率   | ベンチマーク                       | 騰落率   | 組入比率 | 先物比率 | 組入比率 |
| (期首) 2022年11月30日 | 43,159 | —     | 41,586                       | —     | 89.7 | 8.1  | 2.2  |
| 12月末             | 40,510 | △ 6.1 | 39,012                       | △ 6.2 | 91.3 | 6.4  | 2.2  |
| 2023年 1月末        | 42,041 | △ 2.6 | 40,506                       | △ 2.6 | 90.2 | 7.6  | 2.3  |
| 2月末              | 43,520 | 0.8   | 41,881                       | 0.7   | 93.0 | 5.0  | 2.2  |
| 3月末              | 43,305 | 0.3   | 41,662                       | 0.2   | 92.4 | 5.6  | 2.1  |
| 4月末              | 44,495 | 3.1   | 42,776                       | 2.9   | 92.2 | 5.7  | 2.1  |
| 5月末              | 46,568 | 7.9   | 44,784                       | 7.7   | 91.8 | 6.4  | 2.0  |
| 6月末              | 50,230 | 16.4  | 48,320                       | 16.2  | 92.8 | 5.1  | 2.0  |
| 7月末              | 50,995 | 18.2  | 49,052                       | 18.0  | 91.9 | 6.3  | 2.0  |
| 8月末              | 51,888 | 20.2  | 49,885                       | 20.0  | 90.3 | 7.8  | 1.9  |
| 9月末              | 50,638 | 17.3  | 48,668                       | 17.0  | 92.2 | 6.0  | 1.9  |
| 10月末             | 48,935 | 13.4  | 47,036                       | 13.1  | 90.7 | 7.6  | 1.9  |
| (期末) 2023年11月30日 | 52,771 | 22.3  | 50,700                       | 21.9  | 89.9 | 8.2  | 1.9  |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCI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。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html]

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は最近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

※ベンチマークを「MSCIコクサイ指数 (円ベース)」から「MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース)」に変更しました。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：43,159円 期末：52,771円 騰落率：22.3%

【基準価額の主な変動要因】

海外株式市況が上昇したことや、為替相場が円安になったことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから、2022年末にかけて下落しました。2023年に入ると、FRB (米連邦準備制度理事会) が今後利上げ幅を縮小させるのではないかと期待を背景に上昇しました。2月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、3月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。経営破綻した米国の地方銀行の預金保護やFRBによる金融機関への流動性供給、スイスの金融大手の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、3月下旬には上昇に転じました。その後レンジでの推移をはさみ、6月以降は、米国の債務上限問題の解決や米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から、欧米株ともに上昇しました。8月以降は、米国で堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招いたことから、下落しました。11月に入ると、米国の利上げ打ち止め観測などを背景に米国金利の下落傾向が続き、上昇しました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高米ドル安となりました。その後2023年2月には、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が上昇したことで円安に転じましたが、3月に入り、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりなどから、円高となりました。4月以降は、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、米ドルなどの通貨は対円で上昇 (円安) しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後の運用にあたりましては、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、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ってまいります。

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に組み入れ、S & P 500先物取引等の株価指数先物も一部利用し、株式組入比率 (投資信託証券、株価指数先物を含む) につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は21.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.3%となりました。

ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

外国株式インデックスマザーファンド

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）です。

《今後の運用方針》  
今後の運用にあたりまして、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、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ってまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目                                     | 当 期                        |
|-----------------------------------------|----------------------------|
| 売買委託手数料<br>(株式)<br>(先物・オプション)<br>(投資証券) | 2円<br>( 1)<br>( 1)<br>( 0) |
| 有価証券取引税<br>(株式)<br>(投資証券)               | 2<br>( 2)<br>( 0)          |
| その他費用<br>(保管費用)<br>(その他)                | 8<br>( 8)<br>( 0)          |
| 合 計                                     | 12                         |

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。  
(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1)株 式 (2022年12月 1 日から2023年11月30日まで)

|     |          | 買 付                           |                                  | 売 付            |                      |
|-----|----------|-------------------------------|----------------------------------|----------------|----------------------|
|     |          | 株 数                           | 金 額                              | 株 数            | 金 額                  |
| 外 国 | アメリカ     | 百株<br>( 26,739.9<br>572.12)   | 千アメリカ・ドル<br>256,972<br>(△ 5,151) | 百株<br>3,369.84 | 千アメリカ・ドル<br>8,533    |
|     | カナダ      | 百株<br>( 2,442<br>71.1)        | 千カナダ・ドル<br>13,997<br>(△ 810)     | 百株<br>426      | 千カナダ・ドル<br>413       |
|     | オーストラリア  | 百株<br>( 5,460.54<br>32.77)    | 千オーストラリア・ドル<br>10,750<br>( ー)    | 百株<br>1,113.97 | 千オーストラリア・ドル<br>1,263 |
|     | 香港       | 百株<br>( 6,507<br>ー)           | 千香港・ドル<br>24,651<br>( ー)         | 百株<br>820      | 千香港・ドル<br>1,118      |
|     | シンガポール   | 百株<br>( 14,098<br>12,844.22)  | 千シンガポール・ドル<br>2,839<br>(△ 17)    | 百株<br>128      | 千シンガポール・ドル<br>167    |
|     | ニュージーランド | 百株<br>( 569.72<br>ー)          | 千ニュージーランド・ドル<br>749<br>( ー)      | 百株<br>ー        | 千ニュージーランド・ドル<br>ー    |
|     | イギリス     | 百株<br>(△ 16,362.76<br>306.04) | 千イギリス・ポンド<br>11,511<br>( 783)    | 百株<br>1,279.71 | 千イギリス・ポンド<br>1,136   |

|     |                  | 買 付                            |                                | 売 付            |                        |
|-----|------------------|--------------------------------|--------------------------------|----------------|------------------------|
|     |                  | 株 数                            | 金 額                            | 株 数            | 金 額                    |
| 外 国 | イスラエル            | 百株<br>( 614.37<br>ー)           | 千イスラエル・シェケル<br>2,513<br>( ー)   | 百株<br>1,069.08 | 千イスラエル・シェケル<br>1,390   |
|     | スイス              | 百株<br>( 1,315.43<br>255.88)    | 千スイス・フラン<br>8,132<br>(△ 122)   | 百株<br>2,620.45 | 千スイス・フラン<br>128        |
|     | デンマーク            | 百株<br>( 407.63<br>823.58)      | 千デンマーク・クローネ<br>24,258<br>( ー)  | 百株<br>54.65    | 千デンマーク・クローネ<br>922     |
|     | ノルウェー            | 百株<br>( 536.85<br>ー)           | 千ノルウェー・クローネ<br>9,041<br>(△ 14) | 百株<br>ー        | 千ノルウェー・クローネ<br>ー       |
|     | スウェーデン           | 百株<br>( 3,298.61<br>208.94)    | 千スウェーデン・クローネ<br>50,892<br>( ー) | 百株<br>1,623.52 | 千スウェーデン・クローネ<br>16,537 |
|     | ユーロ<br>(アイルランド)  | 百株<br>(△ 1,269.4<br>339.42)    | 千ユーロ<br>1,294<br>(△ 1,322)     | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー              |
|     | ユーロ<br>(オランダ)    | 百株<br>( 1,481.07<br>442.37)    | 千ユーロ<br>6,579<br>( ー)          | 百株<br>168.06   | 千ユーロ<br>986            |
|     | ユーロ<br>(ベルギー)    | 百株<br>( 123.91<br>ー)           | 千ユーロ<br>856<br>( ー)            | 百株<br>60.35    | 千ユーロ<br>60             |
|     | ユーロ<br>(ルクセンブルグ) | 百株<br>( 101.76<br>ー)           | 千ユーロ<br>136<br>( ー)            | 百株<br>435.51   | 千ユーロ<br>42             |
|     | ユーロ<br>(フランス)    | 百株<br>( 1,410.96<br>ー)         | 千ユーロ<br>9,797<br>(△ 28)        | 百株<br>280.16   | 千ユーロ<br>362            |
| 外 国 | ユーロ<br>(ドイツ)     | 百株<br>( 1,683.23<br>ー)         | 千ユーロ<br>8,104<br>(△ 151)       | 百株<br>131.89   | 千ユーロ<br>153            |
|     | ユーロ<br>(ポルトガル)   | 百株<br>( 435.19<br>ー)           | 千ユーロ<br>248<br>( ー)            | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー              |
|     | ユーロ<br>(スペイン)    | 百株<br>( 2,259.36<br>5,532.2)   | 千ユーロ<br>2,243<br>( 151)        | 百株<br>5,856.91 | 千ユーロ<br>981            |
|     | ユーロ<br>(イタリア)    | 百株<br>( 2,379.1<br>ー)          | 千ユーロ<br>1,342<br>(△ 0)         | 百株<br>195.31   | 千ユーロ<br>448            |
|     | ユーロ<br>(フィンランド)  | 百株<br>( 918.49<br>215.14)      | 千ユーロ<br>1,169<br>( ー)          | 百株<br>215.14   | 千ユーロ<br>78             |
|     | ユーロ<br>(オーストリア)  | 百株<br>( 55.35<br>ー)            | 千ユーロ<br>209<br>( ー)            | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー              |
|     | ユーロ<br>(その他)     | 百株<br>( 141.44<br>ー)           | 千ユーロ<br>1,034<br>( ー)          | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー              |
|     | ユーロ<br>(ユーロ通貨計)  | 百株<br>( 12,259.26<br>5,850.29) | 千ユーロ<br>33,017<br>(△ 1,352)    | 百株<br>7,343.33 | 千ユーロ<br>3,112          |

(注 1) 金額は受渡し代金。  
(注 2) ( )内は株式分割、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。  
(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

## (2) 投資証券

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

| 銘 柄                               | 買 付      |             | 売 付   |             |
|-----------------------------------|----------|-------------|-------|-------------|
|                                   | □ 数      | 金 額         | □ 数   | 金 額         |
|                                   | 千口       | 千アメリカ・ドル    | 千口    | 千アメリカ・ドル    |
| <b>アメリカ</b>                       |          |             |       |             |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC         | 1.1      | 196         | —     | —           |
| SIMON PROPERTY GROUP INC          | 2.2      | 258         | —     | —           |
| BOSTON PROPERTIES INC             | 1        | 69          | —     | —           |
| VORNADO REALTY TRUST              | —        | —           | 6.297 | 159         |
| SBA COMMUNICATIONS CORP           | 0.7      | 181         | —     | —           |
| EQUITY RESIDENTIAL                | 2.6      | 165         | —     | —           |
| EQUINIX INC                       | 0.7      | 511         | —     | —           |
| AMERICAN TOWER CORP               | 3.6      | 732         | —     | —           |
| HOST HOTELS & RESORTS INC         | 5.4      | 94          | —     | —           |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A          | 2.7      | 89          | —     | —           |
| KIMCO REALTY CORP                 | 5        | 103         | —     | —           |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS | 3        | 57          | —     | —           |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE      | 1.7      | 85          | —     | —           |
| INVITATION HOMES INC              | 4.4      | 145         | —     | —           |
| VICI PROPERTIES INC               | 8.8      | 285         | —     | —           |
| VENTAS INC                        | 2.9      | 135         | —     | —           |
| WEYERHAEUSER CO                   | 4.6      | 147         | —     | —           |
| NET LEASE OFFICE PROPERTIES       | —        | —           | 0.686 | 10          |
|                                   | ( 0.686) | ( —)        |       |             |
| CROWN CASTLE INTL CORP            | 3.1      | 388         | —     | —           |
| IRON MOUNTAIN INC                 | 2.3      | 129         | —     | —           |
| SUN COMMUNITIES INC               | 1        | 138         | —     | —           |
| PROLOGIS INC                      | 6.5      | 805         | —     | —           |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT      | 1.5      | 201         | —     | —           |
| CAMDEN PROPERTY TRUST             | 1        | 110         | —     | —           |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC          | 0.4      | 90          | —     | —           |
| WELLTOWER INC                     | 5.2      | 390         | —     | —           |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC         | 4.6      | 106         | —     | —           |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM        | 0.8      | 124         | —     | —           |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES       | 1.4      | 94          | —     | —           |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN      | 6        | 122         | —     | —           |
| REALTY INCOME CORP                | 7.7      | 469         | —     | —           |
| PUBLIC STORAGE                    | 1.2      | 349         | —     | —           |
| REGENCY CENTERS CORP              | 1.8      | 112         | —     | —           |
| UDR INC                           | 2.2      | 91          | —     | —           |
| WP CAREY INC                      | 2.3      | 175         | —     | —           |
| DIGITAL REALTY TRUST INC          | 2.3      | 260         | —     | —           |
| EXTRA SPACE STORAGE INC           | 4.9      | 651         | —     | —           |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC      | 3        | 35          | 27.2  | 224         |
|                                   | 千口       | 千カナダ・ドル     | 千口    | 千カナダ・ドル     |
| <b>カナダ</b>                        |          |             |       |             |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA      | 0.4      | 19          | —     | —           |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR       | 1.1      | 21          | —     | —           |
|                                   | 千口       | 千オーストラリア・ドル | 千口    | 千オーストラリア・ドル |
| <b>オーストラリア</b>                    |          |             |       |             |
| DEXUS/AU                          | 7.753    | 62          | —     | —           |
| LENLEASE GROUP                    | 6.101    | 47          | —     | —           |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘 柄 |                                    | 買            | 付                  | 売       | 付                |
|-----|------------------------------------|--------------|--------------------|---------|------------------|
|     |                                    | □ 数          | 金 額                | □ 数     | 金 額              |
| 外 国 | TRANSURBAN GROUP                   | 千口<br>19.259 | 千オーストラリア・ドル<br>270 | 千口<br>— | 千オーストラリア・ドル<br>— |
|     | APA GROUP                          | 8.309        | 85                 | —       | —                |
|     | SCENTRE GROUP                      | 32.277       | 93                 | —       | —                |
|     | GPT GROUP                          | 13.76        | 60                 | —       | —                |
|     | MIRVAC GROUP                       | 28.18        | 63                 | —       | —                |
|     | STOCKLAND                          | 13.654       | 55                 | —       | —                |
|     | GOODMAN GROUP                      | 10.959       | 224                | —       | —                |
|     | VICINITY CENTRES                   | 23.552       | 45                 | —       | —                |
|     | <b>香港</b>                          | 千口           | 千香港・ドル             | 千口      | 千香港・ドル           |
|     | LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | —            | —                  | 20.22   | 85               |
|     | LINK REIT                          | ( 20.22)     | (△ 90)             | —       | —                |
|     | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS        | 40.7         | 2,023              | —       | —                |
|     | HKT TRUST AND HKT LTD-SS           | ( —)         | ( 90)              | 107     | 536              |
|     |                                    | —            | —                  | —       | —                |
|     |                                    | 34           | 326                | —       | —                |
|     | <b>シンガポール</b>                      | 千口           | 千シンガポール・ドル         | 千口      | 千シンガポール・ドル       |
|     | CAPITALAND ASCENDAS REIT           | 49.5         | 136                | —       | —                |
|     |                                    | ( —)         | (△ 3)              | —       | —                |
|     | CAPITALAND INTEGRATED COMMER       | 56.6         | 113                | —       | —                |
|     |                                    | ( —)         | (△ 0)              | —       | —                |
|     | MAPLETREE LOGISTICS TRUST          | 29.4         | 48                 | —       | —                |
|     |                                    | ( —)         | (△ 4)              | —       | —                |
|     | KEPPEL REIT                        | —            | —                  | 15.14   | 11               |
|     |                                    | ( 15.14)     | ( 10)              | —       | —                |
|     | CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU | —            | —                  | 6.852   | 7                |
|     |                                    | ( 6.852)     | ( 7)               | —       | —                |
|     | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS | 11.4         | 20                 | —       | —                |
|     |                                    | ( —)         | (△ 0)              | —       | —                |
| 国   | <b>イギリス</b>                        | 千口           | 千イギリス・ポンド          | 千口      | 千イギリス・ポンド        |
|     | LAND SECURITIES GROUP PLC          | 5.165        | 34                 | —       | —                |
|     | SEGRO PLC                          | 6.908        | 56                 | —       | —                |
|     | BRITISH LAND CO PLC                | 2.98         | 13                 | 38.375  | 124              |
|     | <b>ユーロ (ベルギー)</b>                  | 千口           | 千ユーロ               | 千口      | 千ユーロ             |
|     | WAREHOUSES DE PAUW SCA             | 1.197        | 30                 | —       | —                |
|     | <b>ユーロ (フランス)</b>                  | 千口           | 千ユーロ               | 千口      | 千ユーロ             |
|     | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD          | 0.954        | 50                 | —       | —                |
|     | GECINA SA                          | 0.347        | 36                 | —       | —                |
|     | KLEPIERRE                          | 1.599        | 38                 | —       | —                |
|     |                                    | ( —)         | (△ 7)              | —       | —                |
|     | COVIVIO                            | 0.399        | 18                 | —       | —                |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の種類別取引状況

(2022年12月 1 日から2023年11月30日まで)

| 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    |        | 百万円      | 百万円      | 百万円   | 百万円   |
|       | 株式先物取引 | 115, 566 | 109, 696 | —     | —     |

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2022年12月 1 日から2023年11月30日まで)

| 当 期                                |       |             |         | 期                                |         |          |         |
|------------------------------------|-------|-------------|---------|----------------------------------|---------|----------|---------|
| 買                                  |       | 付           |         | 売                                |         | 付        |         |
| 銘 柄                                | 株 数   | 金 額         | 平均単価    | 銘 柄                              | 株 数     | 金 額      | 平均単価    |
|                                    | 千株    | 千円          | 円       |                                  | 千株      | 千円       | 円       |
| APPLE INC (アメリカ)                   | 90. 4 | 2, 087, 159 | 23, 088 | JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)         | 8. 8    | 215, 291 | 24, 464 |
| MICROSOFT CORP (アメリカ)              | 47. 5 | 1, 922, 769 | 40, 479 | FERGUSON PLC (ジャージイー)            | 8. 777  | 131, 432 | 14, 974 |
| AMAZON. COM INC (アメリカ)             | 67. 9 | 1, 069, 788 | 15, 755 | KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)        | 7. 276  | 127, 629 | 17, 541 |
| TESLA INC (アメリカ)                   | 28. 8 | 856, 671    | 29, 745 | FERROVIAL SA (スペイン)              | 23. 057 | 104, 629 | 4, 537  |
| NVIDIA CORP (アメリカ)                 | 15. 9 | 729, 013    | 45, 849 | ABIOMED INC (アメリカ)               | 2       | 101, 117 | 50, 558 |
| ALPHABET INC-CL A (アメリカ)           | 38. 5 | 607, 588    | 15, 781 | SWEDISH MATCH AB (スウェーデン)        | 65. 778 | 95, 920  | 1, 458  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ) | 9. 5  | 431, 058    | 45, 374 | NEWCREST MINING LTD (オーストラリア)    | 40. 32  | 89, 555  | 2, 221  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)      | 6. 2  | 430, 394    | 69, 418 | BLACK KNIGHT INC (アメリカ)          | 7. 65   | 86, 679  | 11, 330 |
| JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)         | 19. 8 | 391, 454    | 19, 770 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP (アメリカ) | 9       | 70, 363  | 7, 818  |
| JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)           | 16. 4 | 377, 025    | 22, 989 | INVESTOR CLASS A (スウェーデン)        | 23. 863 | 68, 354  | 2, 864  |

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

| 銘柄                           | 期首     |        | 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    |            |  |     |
|                              | 百株     | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |  |     |
| (アメリカ)                       |        |        |          |           |            |  |     |
| BROADRIDGE FINANCIAL SolutIO | 49     | 57     | 1,086    | 159,813   | 資本財・サービス   |  |     |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 123    | 148    | 4,275    | 628,851   | 情報技術       |  |     |
| FIRST SOLAR INC              | —      | 49     | 761      | 112,009   | 情報技術       |  |     |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN     | 75     | 86     | 1,185    | 174,390   | 情報技術       |  |     |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 54     | 62     | 771      | 113,495   | 資本財・サービス   |  |     |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 26     | 31     | 354      | 52,093    | ヘルスケア      |  |     |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 211    | 211    | 658      | 96,881    | 金融         |  |     |
| ABBOTT LABORATORIES          | 723.66 | 840.66 | 8,711    | 1,281,238 | ヘルスケア      |  |     |
| HOWMET AEROSPACE INC         | 155.83 | 189.83 | 979      | 144,030   | 資本財・サービス   |  |     |
| VERISK ANALYTICS INC         | 65     | 71     | 1,691    | 248,790   | 資本財・サービス   |  |     |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 139    | 166    | 752      | 110,691   | 一般消費財・サービス |  |     |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数       | 株数       | 期末評価額    |            | 業種等            |
|------------------------------|----------|----------|----------|------------|----------------|
|                              |          |          | 当期       |            |                |
|                              |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額     |                |
|                              | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円         |                |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 247      | 288      | 2,597    | 381,967    | 情報技術           |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 18       | 22       | 1,215    | 178,750    | 情報技術           |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 253      | 287      | 1,669    | 245,572    | 金融             |
| QORVO INC                    | 44.2     | 48.2     | 462      | 67,974     | 情報技術           |
| AFLAC INC                    | 253      | 278      | 2,269    | 333,748    | 金融             |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 51       | 59       | 918      | 135,128    | 一般消費財・サービス     |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 71       | 79       | 660      | 97,130     | コミュニケーション・サービス |
| ADOBE INC                    | 195.2    | 220.2    | 13,594   | 1,999,406  | 情報技術           |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 86       | 94       | 702      | 103,338    | 素材             |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 48       | 56       | 2,454    | 361,021    | 一般消費財・サービス     |
| GARMIN LTD                   | 63       | 74       | 895      | 131,686    | 一般消費財・サービス     |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 92       | 107      | 2,851    | 419,345    | 素材             |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 282      | 322      | 6,255    | 919,948    | 資本財・サービス       |
| WR BERKLEY CORP              | 86.42    | 101.42   | 715      | 105,261    | 金融             |
| AUTOZONE INC                 | 8.2      | 9.2      | 2,388    | 351,319    | 一般消費財・サービス     |
| DOLLAR TREE INC              | 92.71    | 102.71   | 1,244    | 182,958    | 生活必需品          |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 478      | 583      | 564      | 83,083     | ヘルスケア          |
| CELANESE CORP                | 44.5     | 49.5     | 680      | 100,055    | 素材             |
| DR HORTON INC                | 138.16   | 149.16   | 1,898    | 279,169    | 一般消費財・サービス     |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 89       | 103      | 322      | 47,459     | ヘルスケア          |
| AUTODESK INC                 | 90       | 103      | 2,202    | 323,944    | 情報技術           |
| MOODY'S CORP                 | 69       | 80       | 2,895    | 425,785    | 金融             |
| DEVON ENERGY CORP            | 259      | 310      | 1,391    | 204,615    | エネルギー          |
| ALBEMARLE CORP               | 48       | 57       | 703      | 103,429    | 素材             |
| ATMOS ENERGY CORP            | 58       | 70       | 784      | 115,354    | 公益事業           |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 102      | 122      | 609      | 89,605     | 公益事業           |
| CITIGROUP INC                | 804.73   | 941.73   | 4,308    | 633,638    | 金融             |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 174      | 200      | 4,583    | 674,051    | 資本財・サービス       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 213      | 249      | 1,972    | 290,088    | 公益事業           |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 15.3     | 17.3     | 672      | 98,938     | 一般消費財・サービス     |
| HESS CORP                    | 116      | 134      | 1,870    | 275,036    | エネルギー          |
| DAVITA INC                   | 27.5     | 27.5     | 273      | 40,286     | ヘルスケア          |
| DANAHER CORP                 | 286.5    | 339.5    | 7,554    | 1,111,048  | ヘルスケア          |
| FORTIVE CORP                 | 141      | 171      | 1,157    | 170,283    | 資本財・サービス       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 231      | 271      | 3,053    | 449,136    | 金融             |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 233      | 263      | 1,924    | 283,094    | 生活必需品          |
| BUNGE LTD                    | 63       | —        | —        | —          | 生活必需品          |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 131.95   | 151.95   | 1,981    | 291,475    | 情報技術           |
| APPLE INC                    | 6,700    | 7,604    | 143,996  | 21,177,631 | 情報技術           |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 116      | 124      | 1,102    | 162,105    | 金融             |
| BOEING CO/THE                | 233      | 277      | 6,216    | 914,291    | 資本財・サービス       |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 62.15    | 76.15    | 766      | 112,732    | 金融             |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 117.99   | 136.99   | 3,228    | 474,847    | ヘルスケア          |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 54       | 63       | 669      | 98,417     | 資本財・サービス       |
| NISOURCE INC                 | 165      | 200      | 516      | 75,917     | 公益事業           |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 53       | 55       | 448      | 65,980     | 資本財・サービス       |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 317.71   | 375.71   | 1,786    | 262,740    | 金融             |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 1,737.04 | 2,034.04 | 7,680    | 1,129,576  | コミュニケーション・サービス |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 532.5    | 627.5    | 22,507   | 3,310,221  | 金融             |
| ANSYS INC                    | 36       | 42       | 1,255    | 184,604    | 情報技術           |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 551.17   | 644.17   | 2,069    | 304,393    | 金融             |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE     | 290      | 342      | 3,808    | 560,168    | 金融             |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 883      | 1,016    | 4,949    | 727,989    | ヘルスケア          |

| 銘                            | 柄 | 期 首     | 当       | 期 末      |           | 業 種 等          |
|------------------------------|---|---------|---------|----------|-----------|----------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数     | 評 価 額    |           |                |
|                              |   |         |         | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                |
|                              |   | 百株      | 百株      | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| JPMORGAN CHASE & CO          |   | 1,214.7 | 1,412.7 | 21,800   | 3,206,241 | 金融             |
| T ROWE PRICE GROUP INC       |   | 93      | 109     | 1,080    | 158,959   | 金融             |
| LKQ CORP                     |   | 111     | 129     | 572      | 84,216    | 一般消費財・サービス     |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    |   | 128.12  | 150.12  | 874      | 128,561   | 生活必需品          |
| CADENCE DESIGN SYS INC       |   | 114     | 132     | 3,632    | 534,271   | 情報技術           |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     |   | 45      | 50      | 1,741    | 256,159   | 金融             |
| DOLLAR GENERAL CORP          |   | 94      | 106     | 1,366    | 200,916   | 生活必需品          |
| SERVICENOW INC               |   | 83      | 99      | 6,721    | 988,517   | 情報技術           |
| CATERPILLAR INC              |   | 221     | 249     | 6,211    | 913,496   | 資本財・サービス       |
| BROWN & BROWN INC            |   | 97      | 117     | 853      | 125,560   | 金融             |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      |   | 103     | 121     | 427      | 62,942    | 公益事業           |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   |   | 21      | 25      | 492      | 72,468    | ヘルスケア          |
| CMS ENERGY CORP              |   | 120     | 141     | 800      | 117,681   | 公益事業           |
| MOSAIC CO/THE                |   | 149     | 161     | 586      | 86,236    | 素材             |
| DELTA AIR LINES INC          |   | 62      | 78      | 285      | 42,031    | 資本財・サービス       |
| CORNING INC                  |   | 332     | 391     | 1,103    | 162,277   | 情報技術           |
| CISCO SYSTEMS INC            |   | 1,713.5 | 1,970.5 | 9,468    | 1,392,495 | 情報技術           |
| MORGAN STANLEY               |   | 541.52  | 605.52  | 4,756    | 699,517   | 金融             |
| DECKERS OUTDOOR CORP         |   | —       | 13      | 851      | 125,228   | 一般消費財・サービス     |
| MSCI INC                     |   | 34      | 39      | 2,053    | 302,026   | 金融             |
| FAIR ISAAC CORP              |   | 11      | 12      | 1,290    | 189,737   | 情報技術           |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     |   | 13      | 15      | 601      | 88,495    | 資本財・サービス       |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC     |   | —       | 32      | 715      | 105,236   | 情報技術           |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   |   | 94      | 108     | 604      | 88,947    | 資本財・サービス       |
| BROADCOM INC                 |   | 167.12  | 199.12  | 18,733   | 2,755,180 | 情報技術           |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     |   | —       | 23      | 533      | 78,500    | ヘルスケア          |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    |   | —       | 31      | 396      | 58,334    | 一般消費財・サービス     |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  |   | 50      | 60      | 984      | 144,725   | ヘルスケア          |
| ARAMARK                      |   | 96      | 120     | 333      | 49,027    | 一般消費財・サービス     |
| DTE ENERGY COMPANY           |   | 79      | 100     | 1,041    | 153,158   | 公益事業           |
| CENTENE CORP                 |   | 242.07  | 265.07  | 1,868    | 274,758   | ヘルスケア          |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      |   | 44      | 51      | 915      | 134,635   | 金融             |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     |   | 202     | 234     | 637      | 93,744    | 金融             |
| DARLING INGREDIENTS INC      |   | —       | 75      | 312      | 45,929    | 生活必需品          |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      |   | 87      | 104     | 2,548    | 374,764   | 金融             |
| GARTNER INC                  |   | 33.5    | 38.5    | 1,655    | 243,542   | 情報技術           |
| SPLUNK INC                   |   | 67      | 76      | 1,144    | 168,330   | 情報技術           |
| DOMINION ENERGY INC          |   | 335.41  | 404.41  | 1,889    | 277,934   | 公益事業           |
| MONSTER BEVERAGE CORP        |   | 164     | 380     | 2,078    | 305,755   | 生活必需品          |
| SMITH (A. O.) CORP           |   | 53      | 60      | 450      | 66,269    | 資本財・サービス       |
| DEERE & CO                   |   | 120     | 135     | 4,913    | 722,582   | 資本財・サービス       |
| QUANTA SERVICES INC          |   | 60      | 70      | 1,299    | 191,083   | 資本財・サービス       |
| POOL CORP                    |   | 17      | 19      | 656      | 96,493    | 一般消費財・サービス     |
| GLOBAL PAYMENTS INC          |   | 116.84  | 126.84  | 1,475    | 217,062   | 金融             |
| VMWARE INC-CLASS A           |   | 87      | —       | —        | —         | 情報技術           |
| CABLE ONE INC                |   | 2       | —       | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| BURLINGTON STORES INC        |   | 27      | 31      | 531      | 78,198    | 一般消費財・サービス     |
| NASDAQ INC                   |   | 143     | 166     | 924      | 135,983   | 金融             |
| VAIL RESORTS INC             |   | 17      | 19      | 408      | 60,139    | 一般消費財・サービス     |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A  |   | 209     | —       | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| TARGA RESOURCES CORP         |   | 90      | 104     | 915      | 134,613   | エネルギー          |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC |   | 30      | 34      | 376      | 55,439    | 金融             |
| WESTLAKE CORP                |   | 16      | 18      | 231      | 34,088    | 素材             |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 期首     | 当      | 期末       |           | 業種等            |
|------------------------------|--------|--------|----------|-----------|----------------|
|                              | 株数     | 株数     | 評価額      |           |                |
|                              |        |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                |
|                              | 百株     | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 147    | 168    | 1,510    | 222,221   | 公益事業           |
| COGNEX CORP                  | 69     | 84     | 315      | 46,462    | 情報技術           |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       | 73     | 85     | 378      | 55,679    | 金融             |
| TELEFLEX INC                 | 19     | 23     | 508      | 74,840    | ヘルスケア          |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 35     | 40     | 728      | 107,096   | 資本財・サービス       |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 31     | 36     | 1,256    | 184,736   | ヘルスケア          |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 9      | 11     | 334      | 49,259    | ヘルスケア          |
| CATALENT INC                 | 69     | 87     | 344      | 50,630    | ヘルスケア          |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 58     | 70     | 1,213    | 178,472   | ヘルスケア          |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 24     | 28     | 982      | 144,466   | ヘルスケア          |
| CARLISLE COS INC             | 22     | 25     | 687      | 101,151   | 資本財・サービス       |
| IDEX CORP                    | 31     | 37     | 733      | 107,906   | 資本財・サービス       |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 329    | 381    | 2,967    | 436,390   | 生活必需品          |
| ROLLINS INC                  | 92.07  | 116.07 | 466      | 68,605    | 資本財・サービス       |
| AECOM                        | —      | 64     | 561      | 82,641    | 資本財・サービス       |
| WATSCO INC                   | —      | 16     | 608      | 89,524    | 資本財・サービス       |
| GRACO INC                    | —      | 80     | 640      | 94,242    | 資本財・サービス       |
| AMETEK INC                   | 96     | 112    | 1,712    | 251,821   | 資本財・サービス       |
| TORO CO                      | —      | 49     | 404      | 59,460    | 資本財・サービス       |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 100    | 118    | 1,116    | 164,275   | 生活必需品          |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 64.5   | 78.5   | 417      | 61,454    | 資本財・サービス       |
| HEICO CORP                   | 18     | 21     | 354      | 52,124    | 資本財・サービス       |
| GENERAC HOLDINGS INC         | 26     | 30     | 346      | 51,003    | 資本財・サービス       |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 16     | 18     | 817      | 120,288   | 金融             |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 108    | 126    | 1,184    | 174,189   | 素材             |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 17     | 20     | 814      | 119,806   | 情報技術           |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 182.6  | 213.6  | 12,556   | 1,846,712 | 生活必需品          |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       | 32.5   | —      | —        | —         | 情報技術           |
| EPAM SYSTEMS INC             | 24     | 28     | 733      | 107,882   | 情報技術           |
| RPM INTERNATIONAL INC        | 53     | 62     | 627      | 92,332    | 素材             |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM    | —      | 28     | 756      | 111,287   | 素材             |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 12     | 13     | 2,845    | 418,538   | 一般消費財・サービス     |
| UGI CORP                     | 85     | —      | —        | —         | 公益事業           |
| CUMMINS INC                  | 58     | 68     | 1,522    | 223,967   | 資本財・サービス       |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 323    | —      | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| CDW CORP/DE                  | 56     | 65     | 1,378    | 202,748   | 情報技術           |
| SIGNATURE BANK               | 26.5   | —      | —        | —         | 金融             |
| COSTAR GROUP INC             | 164    | 198    | 1,662    | 244,432   | 不動産            |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 24     | —      | —        | —         | 金融             |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 40     | 48     | 1,842    | 271,015   | 資本財・サービス       |
| MERCADOLIBRE INC             | 18.9   | 21.9   | 3,527    | 518,740   | 一般消費財・サービス     |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC  | 30     | 35     | 546      | 80,305    | 金融             |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 115.16 | 128.16 | 2,135    | 314,128   | 一般消費財・サービス     |
| DEXCOM INC                   | 162    | 187    | 2,172    | 319,519   | ヘルスケア          |
| NORDSON CORP                 | 20.9   | 24.9   | 579      | 85,179    | 資本財・サービス       |
| COPART INC                   | 174    | 415    | 2,084    | 306,512   | 資本財・サービス       |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | 70     | 83     | 1,276    | 187,728   | エネルギー          |
| SEAGEN INC                   | 57     | 68     | 1,451    | 213,536   | ヘルスケア          |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 31     | 35     | 757      | 111,431   | ヘルスケア          |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 33     | 38     | 823      | 121,173   | 金融             |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 20.9   | 26.9   | 2,563    | 376,953   | 資本財・サービス       |
| BIO-TECHNE CORP              | 15.8   | 76.2   | 480      | 70,736    | ヘルスケア          |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 39     | 46     | 522      | 76,812    | ヘルスケア          |

| 銘柄                           | 株数       | 株数       | 期末評価額    |           | 業種等            |
|------------------------------|----------|----------|----------|-----------|----------------|
|                              |          |          | 当期       |           |                |
|                              |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                |
|                              | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 90       | —        | —        | —         | ヘルスケア          |
| KINDER MORGAN INC            | 843.81   | 974.81   | 1,688    | 248,308   | エネルギー          |
| HCA HEALTHCARE INC           | 98       | 102      | 2,540    | 373,648   | ヘルスケア          |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 16       | 18       | 426      | 62,763    | 金融             |
| COTERRA ENERGY INC           | 330      | 366      | 954      | 140,436   | エネルギー          |
| T-MOBILE US INC              | 259.27   | 260.27   | 3,892    | 572,446   | コミュニケーション・サービス |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 67.5     | 74.5     | 315      | 46,335    | 不動産            |
| COCA-COLA CO/THE             | 1,704.5  | 1,987.5  | 11,573   | 1,702,072 | 生活必需品          |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 88       | 107      | 638      | 93,946    | 生活必需品          |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 69.5     | 73.5     | 878      | 129,196   | 資本財・サービス       |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 124      | 140      | 344      | 50,630    | 金融             |
| CSX CORP                     | 899      | 991      | 3,144    | 462,453   | 資本財・サービス       |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 38       | 43       | 920      | 135,390   | ヘルスケア          |
| EXPEDIA GROUP INC            | 63.25    | 68.25    | 926      | 136,259   | 一般消費財・サービス     |
| AMAZON.COM INC               | 3,788    | 4,467    | 65,361   | 9,612,663 | 一般消費財・サービス     |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 257      | 293      | 1,975    | 290,566   | ヘルスケア          |
| EXXON MOBIL CORP             | 1,742.05 | 1,955.05 | 20,007   | 2,942,573 | エネルギー          |
| AES CORP                     | 271      | 324      | 557      | 82,054    | 公益事業           |
| EVEREST GROUP LTD            | 16       | 21       | 844      | 124,261   | 金融             |
| EOG RESOURCES INC            | 242      | 283      | 3,487    | 512,934   | エネルギー          |
| EQT CORP                     | 141      | 175      | 695      | 102,305   | エネルギー          |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 65       | 73       | 844      | 124,216   | 情報技術           |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   | 5        | 5        | 721      | 106,064   | 金融             |
| ABIOMED INC                  | 19       | —        | —        | —         | ヘルスケア          |
| CENCORA INC                  | 65       | 83       | 1,656    | 243,550   | ヘルスケア          |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 124      | 143      | 1,824    | 268,334   | ヘルスケア          |
| FORD MOTOR CO                | 1,634.23 | 1,901.23 | 2,013    | 296,111   | 一般消費財・サービス     |
| EXACT SCIENCES CORP          | 71       | 87       | 566      | 83,244    | ヘルスケア          |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 62.37    | —        | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| ENTEGRIS INC                 | 62       | 72       | 752      | 110,666   | 情報技術           |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 56       | 82       | 545      | 80,173    | 資本財・サービス       |
| FORTINET INC                 | 282      | 323      | 1,731    | 254,619   | 情報技術           |
| MARKEL CORP                  | 5.5      | 6.1      | 863      | 126,957   | 金融             |
| NEXTERA ENERGY INC           | 812.8    | 978.8    | 5,712    | 840,104   | 公益事業           |
| MASIMO CORP                  | 22       | —        | —        | —         | ヘルスケア          |
| FREEPORT-MCMORAN INC         | 599.08   | 693.08   | 2,576    | 378,878   | 素材             |
| INSULET CORP                 | 29       | 34       | 642      | 94,467    | ヘルスケア          |
| US BANCORP                   | 584      | 741      | 2,800    | 411,831   | 金融             |
| UNITED RENTALS INC           | 30       | 33       | 1,571    | 231,124   | 資本財・サービス       |
| F5 NETWORKS INC              | 25       | 29       | 493      | 72,526    | 情報技術           |
| SUPER MICRO COMPUTER INC     | —        | 25       | 719      | 105,754   | 情報技術           |
| FASTENAL CO                  | 238      | 276      | 1,646    | 242,086   | 資本財・サービス       |
| FISERV INC                   | 254.33   | 298.33   | 3,859    | 567,572   | 金融             |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 455.06   | 527.06   | 6,264    | 921,339   | 資本財・サービス       |
| AXON ENTERPRISE INC          | —        | 34       | 767      | 112,938   | 資本財・サービス       |
| PAYLOCITY HOLDING CORP       | —        | 22       | 341      | 50,160    | 資本財・サービス       |
| GENERAL MOTORS CO            | 573      | 673      | 2,126    | 312,770   | 一般消費財・サービス     |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 98       | 113      | 2,766    | 406,880   | 資本財・サービス       |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 142.5    | 161.5    | 5,495    | 808,178   | 金融             |
| FIRST HORIZON CORP           | —        | 257      | 325      | 47,813    | 金融             |
| ALPHABET INC-CL A            | 2,488    | 2,873    | 38,782   | 5,703,760 | コミュニケーション・サービス |
| ALPHABET INC-CL C            | 2,333.4  | 2,554.4  | 34,842   | 5,124,215 | コミュニケーション・サービス |
| OWENS CORNING                | 39       | 44       | 590      | 86,803    | 資本財・サービス       |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘                                  | 柄 | 期 首    | 当      | 期 末      |           | 業 種 等          |
|------------------------------------|---|--------|--------|----------|-----------|----------------|
|                                    |   | 株 数    | 株 数    | 評 価 額    |           |                |
|                                    |   |        |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                |
|                                    |   | 百株     | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| GENERAL MILLS INC                  |   | 249    | 283    | 1,771    | 260,504   | 生活必需品          |
| FIRSTENERGY CORP                   |   | 224.18 | 263.18 | 973      | 143,134   | 公益事業           |
| GENUINE PARTS CO                   |   | 59.5   | 68.5   | 916      | 134,854   | 一般消費財・サービス     |
| FIFTH THIRD BANCORP                |   | 284    | 330    | 937      | 137,882   | 金融             |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC          |   | 80.5   | 92.5   | 1,745    | 256,652   | 資本財・サービス       |
| HALLIBURTON CO                     |   | 373    | 436    | 1,626    | 239,176   | エネルギー          |
| REPLIGEN CORP                      |   | —      | 26     | 414      | 60,986    | ヘルスケア          |
| HOME DEPOT INC                     |   | 425.5  | 486.5  | 15,131   | 2,225,334 | 一般消費財・サービス     |
| ASSURANT INC                       |   | 22.5   | 26.5   | 434      | 63,838    | 金融             |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC          |   | 595    | 698    | 776      | 114,254   | 金融             |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE       |   | 17.1   | 19.1   | 446      | 65,661    | 資本財・サービス       |
| HERSHEY CO/THE                     |   | 60     | 71     | 1,318    | 193,928   | 生活必需品          |
| HUMANA INC                         |   | 52     | 60     | 2,894    | 425,688   | ヘルスケア          |
| NXP SEMICONDUCTORS NV              |   | 109    | 126    | 2,574    | 378,640   | 情報技術           |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A            |   | 33.2   | —      | —        | —         | 情報技術           |
| HENRY SCHEIN INC                   |   | 56     | 63     | 419      | 61,763    | ヘルスケア          |
| HP INC                             |   | 473    | 473    | 1,375    | 202,222   | 情報技術           |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE         |   | 538    | 625    | 1,032    | 151,849   | 情報技術           |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C       |   | 68.28  | —      | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C       |   | 79     | —      | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A       |   | 29.5   | —      | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD             |   | 154    | 180    | 1,482    | 218,081   | 金融             |
| KRAFT HEINZ CO/THE                 |   | 304.03 | 418.03 | 1,466    | 215,670   | 生活必需品          |
| ENPHASE ENERGY INC                 |   | 56     | 66     | 666      | 97,998    | 情報技術           |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP        |   | 372    | 439    | 6,866    | 1,009,841 | 情報技術           |
| HUBBELL INC                        |   | —      | 26     | 766      | 112,672   | 資本財・サービス       |
| INTERNATIONAL PAPER CO             |   | 143    | 160    | 572      | 84,218    | 素材             |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC     |   | 52     | 61     | 415      | 61,040    | 資本財・サービス       |
| ZOETIS INC                         |   | 195    | 224    | 3,937    | 579,116   | ヘルスケア          |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC             |   | 96.99  | 109.99 | 2,448    | 360,131   | 資本財・サービス       |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP         |   | —      | 68     | 401      | 59,064    | 情報技術           |
| CHENIERE ENERGY INC                |   | 95     | 117    | 2,111    | 310,486   | エネルギー          |
| HYATT HOTELS CORP - CL A           |   | —      | 23     | 261      | 38,497    | 一般消費財・サービス     |
| ALLEGION PLC                       |   | 36.5   | 43.5   | 454      | 66,911    | 資本財・サービス       |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC           |   | —      | 68     | 917      | 134,900   | 資本財・サービス       |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C              |   | 129.73 | —      | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC              |   | 106.37 | 125.37 | 1,662    | 244,563   | 資本財・サービス       |
| JUNIPER NETWORKS INC               |   | 134    | 156    | 437      | 64,331    | 情報技術           |
| JM SMUCKER CO/THE                  |   | 44     | 50     | 542      | 79,844    | 生活必需品          |
| JOHNSON & JOHNSON                  |   | 1,089  | 1,165  | 17,720   | 2,606,200 | ヘルスケア          |
| PLUG POWER INC                     |   | 211    | —      | —        | —         | 資本財・サービス       |
| ABBVIE INC                         |   | 730.72 | 852.72 | 11,810   | 1,736,921 | ヘルスケア          |
| HOLOGIC INC                        |   | 101    | 119    | 840      | 123,559   | ヘルスケア          |
| KIMBERLY-CLARK CORP                |   | 139    | 163    | 1,984    | 291,912   | 生活必需品          |
| KROGER CO                          |   | 286    | 330    | 1,440    | 211,798   | 生活必需品          |
| KLA CORP                           |   | 62     | 66     | 3,590    | 528,108   | 情報技術           |
| LOCKHEED MARTIN CORP               |   | 99     | 110    | 4,895    | 719,923   | 資本財・サービス       |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          |   | 31     | 34     | 806      | 118,624   | 金融             |
| BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE |   | 105    | 105    | 336      | 49,492    | 一般消費財・サービス     |
| LOWE'S COS INC                     |   | 272    | 283    | 5,657    | 832,083   | 一般消費財・サービス     |
| ELI LILLY & CO                     |   | 333.85 | 389.85 | 23,073   | 3,393,443 | ヘルスケア          |
| LAM RESEARCH CORP                  |   | 56.8   | 64.8   | 4,626    | 680,442   | 情報技術           |
| LOEWS CORP                         |   | 86     | 94     | 643      | 94,712    | 金融             |

| 銘柄                           | 株数       | 株数       | 期末評価額    |           | 業種等            |
|------------------------------|----------|----------|----------|-----------|----------------|
|                              |          |          | 外貨建金額    |           |                |
|                              |          |          | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 66.49    | —        | —        | —         | 金融             |
| MCDONALD'S CORP              | 306.5    | 353.5    | 9,911    | 1,457,674 | 一般消費財・サービス     |
| 3M CO                        | 234.9    | 266.9    | 2,628    | 386,524   | 資本財・サービス       |
| META PLATFORMS INC CLASS A   | 948      | 1,070    | 35,545   | 5,227,661 | コミュニケーション・サービス |
| S&P GLOBAL INC               | 144.39   | 159.39   | 6,608    | 971,977   | 金融             |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 26       | 30       | 1,388    | 204,161   | 素材             |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC   | 23.2     | 27.2     | 213      | 31,422    | 情報技術           |
| ALCOA CORP                   | 77       | —        | —        | —         | 素材             |
| PHILLIPS 66                  | 199      | 222      | 2,713    | 399,042   | エネルギー          |
| ATLISSIAN CORP PLC-CLASS A   | —        | 73       | 1,427    | 209,944   | 情報技術           |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 160.5    | 160.5    | 632      | 93,073    | 一般消費財・サービス     |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 104      | 121      | 777      | 114,389   | 生活必需品          |
| METLIFE INC                  | 284      | 315      | 1,989    | 292,601   | 金融             |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 352      | 416      | 2,333    | 343,226   | 情報技術           |
| ARISTA NETWORKS INC          | 102      | 127      | 2,785    | 409,606   | 情報技術           |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 68.98    | 80.98    | 2,583    | 379,967   | 情報技術           |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 9        | 11       | 1,201    | 176,730   | ヘルスケア          |
| BAKER HUGHES CO              | 408.23   | 490.23   | 1,634    | 240,375   | エネルギー          |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 48       | 56       | 1,515    | 222,831   | 資本財・サービス       |
| MERCK & CO. INC.             | 1,046.21 | 1,227.21 | 12,410   | 1,825,252 | ヘルスケア          |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | 207.51   | 225.51   | 1,611    | 236,936   | 素材             |
| MASCO CORP                   | 98       | 109      | 658      | 96,776    | 資本財・サービス       |
| M & T BANK CORP              | 73.99    | 79.99    | 1,021    | 150,263   | 金融             |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 207.7    | 238.7    | 4,686    | 689,228   | 金融             |
| BLACK KNIGHT INC             | 63.5     | —        | —        | —         | 情報技術           |
| HEICO CORP-CLASS A           | 30.2     | 36.2     | 492      | 72,400    | 資本財・サービス       |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 115.02   | 124.02   | 2,511    | 369,315   | 一般消費財・サービス     |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 82       | 100      | 2,634    | 387,514   | 情報技術           |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 29       | —        | —        | —         | 一般消費財・サービス     |
| BLOCK INC CLASS A            | 215.12   | 263.12   | 1,676    | 246,616   | 金融             |
| TRANSUNION                   | 80       | 93       | 546      | 80,410    | 資本財・サービス       |
| VISTRA CORP                  | 176      | 176      | 614      | 90,388    | 公益事業           |
| NOVOCURE LTD                 | 38.5     | —        | —        | —         | ヘルスケア          |
| NETAPP INC                   | 92       | 103      | 922      | 135,637   | 情報技術           |
| NIKE INC -CL B               | 525      | 596      | 6,578    | 967,434   | 一般消費財・サービス     |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 99       | 110      | 2,365    | 347,949   | 資本財・サービス       |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 229      | 263      | 2,182    | 320,961   | 情報技術           |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 81.05    | 96.05    | 996      | 146,558   | 金融             |
| ALLY FINANCIAL INC           | 142      | 142      | 406      | 59,811    | 金融             |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 61       | 70       | 3,271    | 481,193   | 資本財・サービス       |
| APTIV PLC                    | 112      | 137      | 1,127    | 165,762   | 一般消費財・サービス     |
| NEWMONT CORP                 | 328.11   | 384.11   | 1,551    | 228,110   | 素材             |
| MCKESSON CORP                | 61       | 65       | 2,968    | 436,584   | ヘルスケア          |
| XYLEM INC                    | 73       | 116      | 1,200    | 176,572   | 資本財・サービス       |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 641      | 751      | 7,033    | 1,034,360 | 生活必需品          |
| NUCOR CORP                   | 111      | 122      | 1,998    | 293,862   | 素材             |
| WESTERN UNION CO             | 152.46   | —        | —        | —         | 金融             |
| GODADDY INC - CLASS A        | 68       | 70       | 685      | 100,807   | 情報技術           |
| NEWELL BRANDS INC            | 164.42   | —        | —        | —         | 一般消費財・サービス     |
| EVERGY INC                   | 93.5     | 111.5    | 564      | 83,041    | 公益事業           |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 388.24   | 335.24   | 2,022    | 297,449   | エネルギー          |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 11.5     | 12.5     | 358      | 52,755    | 金融             |
| OKTA INC                     | 62       | 75       | 530      | 78,061    | 情報技術           |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数       | 当<br>株数  | 期末<br>評価額 |           | 業種等            |
|------------------------------|----------|----------|-----------|-----------|----------------|
|                              |          |          | 外貨建金額     |           |                |
|                              |          |          | 千アメリカ・ドル  | 千円        |                |
| COUPA SOFTWARE INC           | 29       | —        | —         | —         | 情報技術           |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 56       | 58       | 477       | 70,296    | コミュニケーション・サービス |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 173.05   | —        | —         | —         | ヘルスケア          |
| LINDE PLC                    | 208.46   | —        | —         | —         | 素材             |
| WIX.COM LTD                  | 23.1     | 28.1     | 286       | 42,198    | 情報技術           |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 158      | 168      | 503       | 74,024    | 金融             |
| KKR & CO INC                 | 233      | 292      | 2,182     | 320,966   | 金融             |
| PAYCHEX INC                  | 134      | 157      | 1,902     | 279,735   | 資本財・サービス       |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 27       | 29       | 2,824     | 415,388   | 一般消費財・サービス     |
| ALTRIA GROUP INC             | 749      | 863      | 3,603     | 530,023   | 生活必需品          |
| P G & E CORP                 | 617      | 920      | 1,579     | 232,317   | 公益事業           |
| PFIZER INC                   | 2,321.13 | 2,731.13 | 8,215     | 1,208,215 | ヘルスケア          |
| CIGNA CORP                   | 131      | 143      | 3,759     | 552,842   | ヘルスケア          |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 118.01   | 124.01   | 930       | 136,895   | 情報技術           |
| XCEL ENERGY INC              | 225      | 266      | 1,596     | 234,723   | 公益事業           |
| STERIS PLC                   | 41       | 48       | 947       | 139,380   | ヘルスケア          |
| SEA LTD-ADR                  | 155      | 190      | 698       | 102,663   | コミュニケーション・サービス |
| FOX CORP - CLASS B           | 60.33    | 65.33    | 180       | 26,604    | コミュニケーション・サービス |
| FOX CORP - CLASS A           | 127.99   | 136.99   | 405       | 59,595    | コミュニケーション・サービス |
| STRYKER CORP                 | 140.8    | 164.8    | 4,851     | 713,468   | ヘルスケア          |
| LYFT INC-A                   | 125      | —        | —         | —         | 資本財・サービス       |
| DOW INC                      | 301.18   | 342.18   | 1,756     | 258,315   | 素材             |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 45       | 53       | 503       | 74,057    | 金融             |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 94       | 115      | 781       | 114,924   | 情報技術           |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 53       | 62       | 2,653     | 390,319   | 資本財・サービス       |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 609      | 881      | 4,968     | 730,767   | 資本財・サービス       |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 95       | 113      | 2,597     | 382,035   | エネルギー          |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 992.67   | 1,139.67 | 17,223    | 2,533,109 | 生活必需品          |
| EXELON CORP                  | 405.22   | 481.22   | 1,847     | 271,697   | 公益事業           |
| TELADOC HEALTH INC           | 65       | —        | —         | —         | ヘルスケア          |
| INGERSOLL-RAND INC           | 168.08   | 196.08   | 1,364     | 200,708   | 資本財・サービス       |
| NVR INC                      | 1.3      | 1.6      | 977       | 143,707   | 一般消費財・サービス     |
| CONOCOPHILLIPS               | 535.02   | 585.02   | 6,667     | 980,585   | エネルギー          |
| TWILIO INC - A               | 70       | 83       | 548       | 80,723    | 情報技術           |
| DOCUSIGN INC                 | 83       | 98       | 427       | 62,868    | 情報技術           |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 21       | 25       | 453       | 66,655    | 資本財・サービス       |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | 57       | 71       | 490       | 72,185    | 資本財・サービス       |
| PEPSICO INC                  | 572      | 666      | 11,132    | 1,637,309 | 生活必需品          |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 18.2     | 22.2     | 442       | 65,057    | 情報技術           |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 121      | 126      | 353       | 52,034    | 情報技術           |
| MONGODB INC                  | 28       | 34       | 1,429     | 210,270   | 情報技術           |
| SNAP INC - A                 | 458      | 497      | 645       | 94,875    | コミュニケーション・サービス |
| CORTEVA INC                  | 298.68   | 343.68   | 1,563     | 229,979   | 素材             |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 155      | 176      | 1,700     | 250,042   | 金融             |
| AMCOR PLC                    | 614      | 711      | 674       | 99,233    | 素材             |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 84       | 108      | 2,531     | 372,374   | 情報技術           |
| ROKU INC                     | 48       | 60       | 640       | 94,198    | コミュニケーション・サービス |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 75       | 94       | 1,233     | 181,406   | 公益事業           |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 262      | 305      | 10,166    | 1,495,241 | 情報技術           |
| PENTAIR PLC                  | 66.75    | 79.75    | 508       | 74,736    | 資本財・サービス       |
| QUALCOMM INC                 | 463      | 539      | 6,894     | 1,013,951 | 情報技術           |
| INVESCO LTD                  | 141      | 167      | 238       | 35,072    | 金融             |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 25.5     | —        | —         | —         | 一般消費財・サービス     |

| 銘柄                           | 株数      | 株数      | 期末評価額    |           | 業種等            |
|------------------------------|---------|---------|----------|-----------|----------------|
|                              |         |         | 外貨建金額    |           |                |
|                              |         |         | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 106     | 118     | 875      | 128,716   | 金融             |
| DATADOG INC - CLASS A        | 100     | 122     | 1,423    | 209,299   | 情報技術           |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 238     | 287     | 955      | 140,471   | コミュニケーション・サービス |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 45      | 52      | 4,204    | 618,380   | ヘルスケア          |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 91      | 107     | 1,711    | 251,673   | 資本財・サービス       |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 17      | 18      | 5,627    | 827,610   | 一般消費財・サービス     |
| ROSS STORES INC              | 145     | 165     | 2,131    | 313,523   | 一般消費財・サービス     |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 38.3    | 43.3    | 700      | 103,068   | 素材             |
| RESMED INC                   | 61      | 71      | 1,127    | 165,870   | ヘルスケア          |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 49.3    | 54.3    | 734      | 108,025   | ヘルスケア          |
| ROBERT HALF INTL INC         | 45      | 52      | 418      | 61,563    | 資本財・サービス       |
| MODERNA INC                  | 139     | 157     | 1,240    | 182,434   | ヘルスケア          |
| HUBSPOT INC                  | 18.8    | 22.8    | 1,132    | 166,492   | 情報技術           |
| REVVITY INC                  | 51      | 61      | 545      | 80,212    | ヘルスケア          |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 350.87  | 403.87  | 2,108    | 310,112   | 資本財・サービス       |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 175.38  | 200.38  | 1,689    | 248,519   | 資本財・サービス       |
| BILL HOLDINGS INC            | 39      | 45      | 305      | 44,963    | 情報技術           |
| AVANTOR INC                  | 248     | 327     | 682      | 100,319   | ヘルスケア          |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 80      | 102     | 352      | 51,783    | 金融             |
| DYNATRACE INC                | 81      | 122     | 651      | 95,866    | 情報技術           |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 183     | 215     | 1,512    | 222,510   | コミュニケーション・サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 386.85  | 453.85  | 747      | 109,933   | 金融             |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A  | 110     | 132     | 187      | 27,605    | コミュニケーション・サービス |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 144     | 184     | 494      | 72,793    | ヘルスケア          |
| IAC/INTERACTIVECORP          | 32.3    | —       | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| MATCH GROUP INC              | 116     | 135     | 438      | 64,487    | コミュニケーション・サービス |
| CHEVRON CORP                 | 772.18  | 878.18  | 12,637   | 1,858,654 | エネルギー          |
| ZSCALER INC                  | 35      | 42      | 839      | 123,439   | 情報技術           |
| EDISON INTERNATIONAL         | 158     | 185     | 1,216    | 178,973   | 公益事業           |
| ETSY INC                     | 52      | 60      | 463      | 68,122    | 一般消費財・サービス     |
| TESLA INC                    | 1,091.5 | 1,379.5 | 33,679   | 4,953,187 | 一般消費財・サービス     |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 92      | 126     | 2,209    | 324,882   | 情報技術           |
| GEN DIGITAL INC              | 236     | 279     | 607      | 89,327    | 情報技術           |
| UNITY SOFTWARE INC           | 79      | 113     | 343      | 50,455    | 情報技術           |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 66.02   | 74.02   | 676      | 99,564    | 資本財・サービス       |
| SYNOPSYS INC                 | 63      | 74      | 4,088    | 601,252   | 情報技術           |
| CHEVY INC - CLASS A          | 39.5    | 57.5    | 101      | 14,993    | 一般消費財・サービス     |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 105     | 133     | 1,041    | 153,176   | 情報技術           |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 49.05   | 50.05   | 1,996    | 293,624   | コミュニケーション・サービス |
| VIATRIS INC                  | 490.21  | 580.21  | 529      | 77,907    | ヘルスケア          |
| DOORDASH INC - A             | 78.5    | 122.5   | 1,163    | 171,080   | 一般消費財・サービス     |
| ROBLOX CORP -CLASS A         | 146     | 203     | 785      | 115,479   | コミュニケーション・サービス |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 156     | 199     | 2,516    | 370,168   | 一般消費財・サービス     |
| CBRE GROUP INC - A           | 136     | 150     | 1,190    | 175,116   | 不動産            |
| SOUTHERN CO/THE              | 440     | 527     | 3,701    | 544,323   | 公益事業           |
| SYSCO CORP                   | 211     | 245     | 1,756    | 258,386   | 生活必需品          |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 99.03   | 112.03  | 1,987    | 292,354   | 金融             |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        | 25      | 29      | 158      | 23,261    | 金融             |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 46      | 53      | 306      | 45,115    | 金融             |
| STEEL DYNAMICS INC           | 78.5    | 81.5    | 941      | 138,428   | 素材             |
| SCHLUMBERGER LTD             | 584.52  | 689.52  | 3,576    | 526,001   | エネルギー          |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 62      | 74      | 239      | 35,228    | 資本財・サービス       |
| AFFIRM HOLDINGS INC          | 77      | —       | —        | —         | 金融             |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘                                  | 柄 | 期 首      | 当        | 期 末      |           | 業 種 等          |
|------------------------------------|---|----------|----------|----------|-----------|----------------|
|                                    |   | 株 数      | 株 数      | 評 価 額    |           |                |
|                                    |   |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                |
|                                    |   | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| AT&T INC                           |   | 2,961.91 | 3,458.91 | 5,638    | 829,184   | コミュニケーション・サービス |
| APA CORP                           |   | 144      | 149      | 541      | 79,567    | エネルギー          |
| SOUTHWEST AIRLINES CO              |   | 60.5     | 69.5     | 176      | 25,890    | 資本財・サービス       |
| ON SEMICONDUCTOR CORP              |   | 180      | 209      | 1,496    | 220,142   | 情報技術           |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC          |   | 87       | 104      | 468      | 68,874    | 一般消費財・サービス     |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE            |   | 102      | 119      | 3,257    | 479,046   | 素材             |
| SEMPRA ENERGY                      |   | 130      | 304      | 2,217    | 326,154   | 公益事業           |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B        |   | 78       | 105      | 552      | 81,273    | 情報技術           |
| CLARIVATE PLC                      |   | 134      | 175      | 134      | 19,817    | 資本財・サービス       |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A        |   | 685      | 877      | 1,739    | 255,897   | 情報技術           |
| UIPATH INC - CLASS A               |   | —        | 175      | 347      | 51,139    | 情報技術           |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS        |   | 84.5     | 88.5     | 694      | 102,147   | 情報技術           |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A       |   | 49       | 81       | 1,035    | 152,267   | 金融             |
| TEXAS INSTRUMENTS INC              |   | 381      | 439      | 6,725    | 989,116   | 情報技術           |
| SALESFORCE.COM INC                 |   | 410.66   | 469.66   | 10,818   | 1,591,094 | 情報技術           |
| WESTROCK CO                        |   | 107      | 124      | 497      | 73,129    | 素材             |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS |   | 166.09   | 192.09   | 1,772    | 260,668   | 金融             |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION       |   | 288.34   | 332.34   | 1,753    | 257,876   | 資本財・サービス       |
| TERADYNE INC                       |   | 66       | 75       | 695      | 102,316   | 情報技術           |
| UNION PACIFIC CORP                 |   | 259.8    | 294.8    | 6,528    | 960,210   | 資本財・サービス       |
| MARATHON OIL CORP                  |   | 299      | 299      | 756      | 111,254   | エネルギー          |
| MARATHON PETROLEUM CORP            |   | 239.88   | 221.88   | 3,270    | 481,059   | エネルギー          |
| RTX CORP                           |   | 614.79   | 706.79   | 5,721    | 841,455   | 資本財・サービス       |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B         |   | 304      | 351      | 5,345    | 786,144   | 資本財・サービス       |
| IQVIA HOLDINGS INC                 |   | 78.04    | 90.04    | 1,925    | 283,131   | ヘルスケア          |
| AMEREN CORPORATION                 |   | 107      | 127      | 977      | 143,801   | 公益事業           |
| UNITEDHEALTH GROUP INC             |   | 387.66   | 449.66   | 24,055   | 3,537,902 | ヘルスケア          |
| APPROVIN CORP CLASS A              |   | 49       | —        | —        | —         | 情報技術           |
| TOAST INC CLASS A                  |   | —        | 144      | 219      | 32,338    | 金融             |
| VERISIGN INC                       |   | 41       | 45       | 952      | 140,106   | 情報技術           |
| LUCID GROUP INC                    |   | 168      | 449      | 195      | 28,791    | 一般消費財・サービス     |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO |   | 132      | 309      | 535      | 78,710    | 一般消費財・サービス     |
| ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO |   | —        | 222      | 198      | 29,123    | 金融             |
| VALERO ENERGY CORP                 |   | 169.42   | 176.42   | 2,189    | 321,939   | エネルギー          |
| ULTA BEAUTY INC                    |   | 22       | 24       | 1,008    | 148,250   | 一般消費財・サービス     |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL        |   | 108.88   | 124.88   | 554      | 81,527    | 金融             |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B        |   | 28.3     | 31.3     | 424      | 62,489    | ヘルスケア          |
| ELEVANCE HEALTH INC                |   | 100      | 115      | 5,351    | 787,065   | ヘルスケア          |
| WALT DISNEY CO/THE                 |   | 752.62   | 883.62   | 8,173    | 1,202,074 | コミュニケーション・サービス |
| WELLS FARGO & CO                   |   | 1,567.22 | 1,771.22 | 7,754    | 1,140,439 | 金融             |
| WASTE MANAGEMENT INC               |   | 172      | 197      | 3,343    | 491,784   | 資本財・サービス       |
| WILLIAMS COS INC                   |   | 504      | 589      | 2,146    | 315,658   | エネルギー          |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY             |   | 46       | 53       | 1,061    | 156,042   | 一般消費財・サービス     |
| WHIRLPOOL CORP                     |   | 24       | 27       | 296      | 43,532    | 一般消費財・サービス     |
| WALMART INC                        |   | 626      | 716      | 11,175   | 1,643,555 | 生活必需品          |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC         |   | 87       | 101      | 1,150    | 169,217   | ヘルスケア          |
| WYNN RESORTS LTD                   |   | 45       | 50       | 418      | 61,526    | 一般消費財・サービス     |
| GRAB HOLDINGS CORP CLASS A         |   | 559      | 974      | 299      | 44,119    | 資本財・サービス       |
| WABTEC CORP                        |   | 71.11    | 87.11    | 1,003    | 147,585   | 資本財・サービス       |
| TJX COMPANIES INC                  |   | 484      | 556      | 4,898    | 720,401   | 一般消費財・サービス     |
| WATERS CORP                        |   | 25       | 29       | 811      | 119,309   | ヘルスケア          |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A       |   | 22       | 25       | 591      | 86,999    | 情報技術           |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC       |   | 304      | 355      | 709      | 104,315   | 生活必需品          |

| 銘柄                                 | 株数       | 株数       | 期末評価額    |           | 業種等            |
|------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|----------------|
|                                    |          |          | 外貨建金額    |           |                |
|                                    |          |          | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC           | 48.63    | 50.63    | 1,219    | 179,281   | 金融             |
| WESTERN DIGITAL CORP               | 127      | 155      | 733      | 107,869   | 情報技術           |
| WEC ENERGY GROUP INC               | 130      | 153      | 1,269    | 186,696   | 公益事業           |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP       | 204      | 241      | 1,525    | 224,324   | 公益事業           |
| VISA INC-CLASS A SHARES            | 681.5    | 782.5    | 19,893   | 2,925,736 | 金融             |
| PPL CORP                           | 304      | 357      | 929      | 136,667   | 公益事業           |
| CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS | 135.24   | 157.24   | 1,895    | 278,844   | 公益事業           |
| PULTEGROUP INC                     | 98.5     | 108.5    | 954      | 140,438   | 一般消費財・サービス     |
| WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES  | 954.53   | 1,118.53 | 1,205    | 177,333   | コミュニケーション・サービス |
| PPG INDUSTRIES INC                 | 98       | 114      | 1,590    | 233,969   | 素材             |
| NORTHERN TRUST CORP                | 82       | 101      | 790      | 116,277   | 金融             |
| FERGUSON PLC                       | —        | 99       | 1,669    | 245,596   | 資本財・サービス       |
| NVIDIA CORP                        | 1,035.8  | 1,194.8  | 57,517   | 8,459,124 | 情報技術           |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP       | 171.13   | 193.13   | 2,556    | 376,007   | 金融             |
| DRAFTKINGS INC CLASS A             | —        | 216      | 826      | 121,572   | 一般消費財・サービス     |
| ASPEN TECHNOLOGY CORP              | —        | 14       | 261      | 38,416    | 情報技術           |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L | 35       | —        | —        | —         | 資本財・サービス       |
| TYSON FOODS INC-CL A               | 121      | 138      | 649      | 95,572    | 生活必需品          |
| NETFLIX INC                        | 183.9    | 214.9    | 10,254   | 1,508,175 | コミュニケーション・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC       | 162      | 187      | 9,217    | 1,355,633 | ヘルスケア          |
| NRG ENERGY INC                     | 98.5     | 111.5    | 522      | 76,826    | 公益事業           |
| GLOBE LIFE INC                     | 38.55    | 42.55    | 511      | 75,256    | 金融             |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 74       | —        | —        | —         | 金融             |
| TEXTRON INC                        | 89       | 98       | 733      | 107,851   | 資本財・サービス       |
| NEWS CORP - CLASS A                | 152.87   | 178.87   | 399      | 58,768    | コミュニケーション・サービス |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP            | 2.5      | 3.5      | 578      | 85,039    | エネルギー          |
| OMNICOM GROUP                      | 83       | 97       | 773      | 113,826   | コミュニケーション・サービス |
| JACOBS SOLUTIONS INC               | 52.2     | 61.2     | 772      | 113,588   | 資本財・サービス       |
| AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA | 209      | —        | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| ORACLE CORP                        | 662.33   | 788.33   | 9,161    | 1,347,335 | 情報技術           |
| MASTERCARD INC - A                 | 359      | 409      | 16,761   | 2,465,134 | 金融             |
| ONEOK INC                          | 185      | 216      | 1,455    | 214,078   | エネルギー          |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC             | 373.52   | —        | —        | —         | コミュニケーション・サービス |
| ROPER TECHNOLOGIES INC             | 44       | 52       | 2,734    | 402,135   | 情報技術           |
| U HAUL NON VOTING SERIES N         | 36       | 46       | 246      | 36,295    | 資本財・サービス       |
| ARES MANAGEMENT CORP CLASS A       | —        | 78       | 866      | 127,505   | 金融             |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP             | —        | 55       | 438      | 64,520    | エネルギー          |
| HF SINCLAIR CORP                   | —        | 73       | 384      | 56,611    | エネルギー          |
| OVINTIV INC                        | —        | 121      | 531      | 78,157    | エネルギー          |
| YUM! BRANDS INC                    | 117      | 136      | 1,707    | 251,059   | 一般消費財・サービス     |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE      | 66       | 82       | 1,287    | 189,349   | コミュニケーション・サービス |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B       | 74       | 92       | 552      | 81,317    | 生活必需品          |
| BANK OF AMERICA CORP               | 2,999.01 | 3,468.01 | 10,511   | 1,545,931 | 金融             |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC          | 19       | 23       | 917      | 134,999   | 情報技術           |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        | 77       | 91       | 816      | 120,102   | ヘルスケア          |
| AMERICAN EXPRESS CO                | 265      | 306      | 5,123    | 753,492   | 金融             |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES         | —        | 200.35   | 1,356    | 199,510   | ヘルスケア          |
| LINDE PLC                          | —        | 237.46   | 9,768    | 1,436,707 | 素材             |
| ANALOG DEVICES INC                 | 214.91   | 241.91   | 4,419    | 650,040   | 情報技術           |
| ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A     | —        | 154      | 328      | 48,241    | 生活必需品          |
| MONDAYCOM LTD                      | —        | 11       | 192      | 28,310    | 情報技術           |
| ADVANCED MICRO DEVICES             | 670.27   | 779.27   | 9,651    | 1,419,410 | 情報技術           |
| LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR | —        | 80.28    | 216      | 31,807    | コミュニケーション・サービス |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘 柄                                | 期 首    | 当      | 期 末      |           | 業 種 等          |
|------------------------------------|--------|--------|----------|-----------|----------------|
|                                    | 株 数    | 株 数    | 評 価 額    |           |                |
|                                    |        |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                |
|                                    | 百株     | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円        |                |
| LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER | —      | 96     | 608      | 89,484    | コミュニケーション・サービス |
| CONFLUENT INC CLASS A              | —      | 85     | 180      | 26,527    | 情報技術           |
| KENVUE INC                         | —      | 741    | 1,487    | 218,829   | 生活必需品          |
| GLOBAL E ONLINE LTD                | —      | 47     | 161      | 23,757    | 一般消費財・サービス     |
| VERALTO CORP                       | —      | 113.16 | 839      | 123,520   | 資本財・サービス       |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP       | 329.72 | 349.72 | 2,267    | 333,442   | 金融             |
| BUNGE GLOBAL LTD                   | —      | 73     | 789      | 116,057   | 生活必需品          |
| LIBERTY GLOBAL LTD CLASS C         | —      | 129.73 | 219      | 32,225    | コミュニケーション・サービス |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC             | 66     | 77     | 739      | 108,714   | 情報技術           |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD        | 93     | 111    | 1,175    | 172,895   | 一般消費財・サービス     |
| AVERY DENNISON CORP                | 34.3   | 39.3   | 755      | 111,181   | 素材             |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A         | 216    | 245    | 1,717    | 252,657   | 情報技術           |
| EMERSON ELECTRIC CO                | 246    | 276    | 2,437    | 358,461   | 資本財・サービス       |
| AON PLC-CLASS A                    | 88     | 99     | 3,188    | 468,975   | 金融             |
| AMGEN INC                          | 226    | 258    | 6,878    | 1,011,588 | ヘルスケア          |
| EATON CORP PLC                     | 165.36 | 193.36 | 4,366    | 642,117   | 資本財・サービス       |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A         | 67     | 80     | 1,903    | 279,962   | 生活必需品          |
| APPLIED MATERIALS INC              | 360    | 406    | 6,064    | 891,834   | 情報技術           |
| CME GROUP INC                      | 149    | 174    | 3,738    | 549,779   | 金融             |
| ECOLAB INC                         | 106    | 124    | 2,339    | 343,998   | 素材             |
| EQUIFAX INC                        | 51     | 59     | 1,277    | 187,946   | 資本財・サービス       |
| GILEAD SCIENCES INC                | 519    | 603    | 4,536    | 667,163   | ヘルスケア          |
| KEURIG DR PEPPER INC               | 323    | 441    | 1,399    | 205,794   | 生活必需品          |
| HORMEL FOODS CORP                  | 124    | 145    | 441      | 64,977    | 生活必需品          |
| STATE STREET CORP                  | 152.13 | 167.13 | 1,198    | 176,335   | 金融             |
| SCHWAB (CHARLES) CORP              | 601.4  | 727.4  | 4,336    | 637,700   | 金融             |
| BAXTER INTERNATIONAL INC           | 208    | 244    | 888      | 130,621   | ヘルスケア          |
| CAMPBELL SOUP CO                   | 86     | 94     | 373      | 54,966    | 生活必需品          |
| CROWN HOLDINGS INC                 | 49.8   | 57.8   | 485      | 71,464    | 素材             |
| CARDINAL HEALTH INC                | 113    | 123    | 1,295    | 190,483   | ヘルスケア          |
| FEDEX CORP                         | 102    | 115    | 2,920    | 429,473   | 資本財・サービス       |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP         | 167.54 | 184.54 | 2,032    | 298,896   | 金融             |
| FMC CORP                           | 51.5   | 60.5   | 318      | 46,873    | 素材             |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES          | 105.13 | 123.13 | 926      | 136,231   | 素材             |
| INTEL CORP                         | 1,692  | 2,017  | 9,064    | 1,333,101 | 情報技術           |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC       | 160    | 187    | 572      | 84,266    | コミュニケーション・サービス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP        | 134.5  | 150.5  | 1,158    | 170,387   | 金融             |
| WOLFSPEED INC                      | —      | 58     | 210      | 30,921    | 情報技術           |
| ILLINOIS TOOL WORKS                | 129    | 147    | 3,540    | 520,657   | 資本財・サービス       |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC             | 386    | 386    | 181      | 26,681    | コミュニケーション・サービス |
| ILLUMINA INC                       | 65     | 76     | 771      | 113,528   | ヘルスケア          |
| SEALED AIR CORP                    | 58     | 67     | 222      | 32,674    | 素材             |
| INTUITIVE SURGICAL INC             | 149    | 170    | 5,282    | 776,959   | ヘルスケア          |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH          | 43.5   | 48.5   | 708      | 104,261   | 情報技術           |
| SNAP-ON INC                        | 22     | 26     | 706      | 103,946   | 資本財・サービス       |
| CARMAX INC                         | 66     | 77     | 486      | 71,524    | 一般消費財・サービス     |
| DUKE ENERGY CORP                   | 318.28 | 373.28 | 3,386    | 497,982   | 公益事業           |
| TARGET CORP                        | 194    | 223    | 2,928    | 430,685   | 生活必需品          |
| DOVER CORP                         | 60     | 68     | 957      | 140,780   | 資本財・サービス       |
| WW GRAINGER INC                    | 19     | 22     | 1,706    | 250,977   | 資本財・サービス       |
| JABIL INC                          | —      | 68     | 783      | 115,248   | 情報技術           |
| CINTAS CORP                        | 38     | 44     | 2,415    | 355,314   | 資本財・サービス       |
| CONAGRA BRANDS INC                 | 199    | 231    | 647      | 95,192    | 生活必需品          |

| 銘柄                           |              | 期 首       | 当          | 期 末       |             | 業 種 等          |
|------------------------------|--------------|-----------|------------|-----------|-------------|----------------|
|                              |              | 株 数       | 株 数        | 評 価 額     |             |                |
|                              |              |           |            | 外貨建金額     | 邦貨換算金額      |                |
|                              |              | 百株        | 百株         | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     |              | —         | 70         | 682       | 100,406     | 生活必需品          |
| CLOROX COMPANY               |              | 51        | 60         | 854       | 125,603     | 生活必需品          |
| ENTERGY CORP                 |              | 84        | 102        | 1,026     | 150,896     | 公益事業           |
| MICROSOFT CORP               |              | 2,941     | 3,416      | 129,415   | 19,033,087  | 情報技術           |
| INCYTE CORP                  |              | 76        | 92         | 491       | 72,239      | ヘルスケア          |
| CVS HEALTH CORP              |              | 541.69    | 619.69     | 4,145     | 609,711     | ヘルスケア          |
| MEDTRONIC PLC                |              | 549.98    | 642.98     | 5,070     | 745,724     | ヘルスケア          |
| MICRON TECHNOLOGY INC        |              | 462       | 530        | 4,064     | 597,776     | 情報技術           |
| BLACKROCK INC                |              | 63        | 72         | 5,380     | 791,318     | 金融             |
| CENTERPOINT ENERGY INC       |              | 260       | 305        | 850       | 125,104     | 公益事業           |
| HASBRO INC                   |              | 54        | 64         | 297       | 43,702      | 一般消費財・サービス     |
| KELLOGG CO                   |              | 104       | 133        | 687       | 101,048     | 生活必需品          |
| KEYCORP                      |              | 386       | 453        | 563       | 82,878      | 金融             |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A |              | 572.11    | 659.11     | 4,642     | 682,812     | 生活必需品          |
| COOPER COS INC/THE           |              | 20        | 24         | 795       | 117,040     | ヘルスケア          |
| CHUBB LTD                    |              | 175.99    | 199.99     | 4,501     | 662,017     | 金融             |
| ARROW ELECTRONICS INC        |              | 27        | 29         | 346       | 51,001      | 情報技術           |
| ALLSTATE CORP                |              | 114       | 127        | 1,720     | 253,066     | 金融             |
| EBAY INC                     |              | 249       | 259        | 1,052     | 154,802     | 一般消費財・サービス     |
| PAYPAL HOLDINGS INC          |              | 455.5     | 512.5      | 2,970     | 436,939     | 金融             |
| EASTMAN CHEMICAL CO          |              | 52        | 58         | 482       | 70,961      | 素材             |
| DISH NETWORK CORP-A          |              | 96        | —          | —         | —           | コミュニケーション・サービス |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  |              | 96        | 112        | 1,406     | 206,886     | 生活必需品          |
| TRIMBLE INC                  |              | 102       | 120        | 551       | 81,041      | 情報技術           |
| LENNAR CORP-A                |              | 106       | 122        | 1,547     | 227,583     | 一般消費財・サービス     |
| LEAR CORP                    |              | 25        | 29         | 390       | 57,496      | 一般消費財・サービス     |
| PROGRESSIVE CORP             |              | 242       | 283        | 4,612     | 678,419     | 金融             |
| PACCAR INC                   |              | 144.37    | 252.55     | 2,306     | 339,148     | 資本財・サービス       |
| BIOGEN INC                   |              | 61        | 70         | 1,624     | 238,903     | ヘルスケア          |
| IDEXX LABORATORIES INC       |              | 35        | 40         | 1,866     | 274,573     | ヘルスケア          |
| STARBUCKS CORP               |              | 474       | 554        | 5,531     | 813,545     | 一般消費財・サービス     |
| PTC INC                      |              | 46        | 54         | 839       | 123,486     | 情報技術           |
| EVERSOURCE ENERGY            |              | 143       | 169        | 1,009     | 148,408     | 公益事業           |
| INTUIT INC                   |              | 110.8     | 134.8      | 7,781     | 1,144,360   | 情報技術           |
| BORGWARNER INC               |              | 97        | 114        | 389       | 57,272      | 一般消費財・サービス     |
| BEST BUY CO INC              |              | 88.5      | 95.5       | 675       | 99,411      | 一般消費財・サービス     |
| BALL CORP                    |              | 130.04    | 152.04     | 833       | 122,580     | 素材             |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       |              | 590.97    | 694.97     | 3,852     | 566,648     | ヘルスケア          |
| ELECTRONIC ARTS INC          |              | 116       | 128        | 1,757     | 258,485     | コミュニケーション・サービス |
| VULCAN MATERIALS CO          |              | 55        | 64         | 1,361     | 200,184     | 素材             |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   |              | 106       | 125        | 4,387     | 645,269     | ヘルスケア          |
| VF CORP                      |              | 134       | 160        | 274       | 40,308      | 一般消費財・サービス     |
| PARAMOUNT GLOBAL CLASS B     |              | 252.25    | 271.25     | 390       | 57,485      | コミュニケーション・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        |              | 22        | 25         | 219       | 32,281      | 一般消費財・サービス     |
| CARNIVAL CORP                |              | 409       | 487        | 726       | 106,790     | 一般消費財・サービス     |
| CLEVELAND-CLIFFS INC         |              | 218       | 250        | 422       | 62,137      | 素材             |
| COMCAST CORP-CLASS A         |              | 1,847.9   | 2,009.9    | 8,367     | 1,230,566   | コミュニケーション・サービス |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   |              | 87        | 87         | 343       | 50,489      | 資本財・サービス       |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   |              | 486       | 576        | 183       | 27,023      | 不動産            |
| アメリカ・ドル通貨計                   | 株 数、 金 額     | 141,212.8 | 165,154.98 | 1,905,237 | 280,203,284 |                |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 597 銘柄    | 603 銘柄     |           | <67.4%>     |                |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                 | 株数     | 株数     | 期末      |         | 業種等            |
|------------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------------|
|                                    |        |        | 評価額     |         |                |
|                                    |        |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |                |
|                                    | 百株     | 百株     | 千カナダ・ドル | 千円      |                |
| (カナダ)                              |        |        |         |         |                |
| ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT | 335    | 358    | 2,729   | 295,308 | 生活必需品          |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING | —      | 161.81 | 785     | 84,955  | 金融             |
| IMPERIAL OIL LTD                   | 95     | 95     | 743     | 80,420  | エネルギー          |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC         | 8      | 9      | 2,894   | 313,175 | 情報技術           |
| RESTAURANT BRANDS INTERN           | 116.87 | 135.87 | 1,286   | 139,217 | 一般消費財・サービス     |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP       | 179    | 209    | 1,393   | 150,802 | 素材             |
| INTACT FINANCIAL CORP              | 71.5   | 81.5   | 1,702   | 184,222 | 金融             |
| BCE INC                            | 49.3   | 49.3   | 261     | 28,338  | コミュニケーション・サービス |
| FRANCO-NEVADA CORP                 | 78     | 88     | 1,363   | 147,588 | 素材             |
| SUNCOR ENERGY INC                  | 582.3  | 606.3  | 2,718   | 294,119 | エネルギー          |
| METRO INC/CN                       | 96     | 107    | 740     | 80,099  | 生活必需品          |
| NATIONAL BANK OF CANADA            | 134    | 155    | 1,387   | 150,147 | 金融             |
| BANK OF NOVA SCOTIA                | 482    | 548    | 3,272   | 354,074 | 金融             |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE        | 366    | 417    | 2,225   | 240,779 | 金融             |
| TORONTO-DOMINION BANK              | 737    | 846    | 7,047   | 762,575 | 金融             |
| GREAT-WEST LIFECO INC              | 114    | 125    | 538     | 58,230  | 金融             |
| ROYAL BANK OF CANADA               | 575.5  | 637.5  | 7,574   | 819,597 | 金融             |
| TOURMALINE OIL CORP                | 129    | 148    | 966     | 104,626 | エネルギー          |
| TC ENERGY CORP                     | 397.5  | 468.5  | 2,361   | 255,560 | エネルギー          |
| PEMBINA PIPELINE CORP              | 223.29 | 253.29 | 1,140   | 123,447 | エネルギー          |
| BARRICK GOLD CORP                  | 721    | 807    | 1,907   | 206,437 | 素材             |
| CAE INC                            | 126    | 142    | 375     | 40,642  | 資本財・サービス       |
| THOMSON REUTERS CORP               | 68.12  | 72.41  | 1,369   | 148,153 | 資本財・サービス       |
| EMPIRE CO LTD 'A'                  | 65     | 71     | 260     | 28,211  | 生活必需品          |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD          | 35     | 35     | 354     | 38,343  | 素材             |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B          | 61.5   | 69.5   | 390     | 42,273  | 素材             |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR       | —      | 176    | 378     | 40,946  | 金融             |
| HYDRO ONE LTD                      | 131    | 152    | 570     | 61,745  | 公益事業           |
| LOBLAW COMPANIES LTD               | 67.6   | 73.6   | 886     | 95,937  | 生活必需品          |
| STANTEC INC                        | —      | 58     | 562     | 60,885  | 資本財・サービス       |
| NORTHLAND POWER INC                | 94     | 112    | 245     | 26,517  | 公益事業           |
| WSP GLOBAL INC                     | 50     | 57     | 1,062   | 114,989 | 資本財・サービス       |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD            | 33     | 37     | 409     | 44,261  | 資本財・サービス       |
| PARKLAND CORP                      | 58     | 66     | 288     | 31,224  | エネルギー          |
| QUEBECOR INC -CL B                 | 60     | 68     | 202     | 21,876  | コミュニケーション・サービス |
| EMERA INC                          | 104    | 126    | 598     | 64,763  | 公益事業           |
| TFI INTERNATIONAL INC              | 33     | 35     | 555     | 60,109  | 資本財・サービス       |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A           | 48     | 61     | 184     | 19,934  | 公益事業           |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B        | 144    | 163    | 935     | 101,278 | コミュニケーション・サービス |
| BRP INC/CA- SUB VOTING             | 16     | 16     | 152     | 16,447  | 一般消費財・サービス     |
| IVANHOE MINES LTD-CL A             | 246    | 267    | 294     | 31,839  | 素材             |
| AGNICO EAGLE MINES LTD             | 185.17 | 226.17 | 1,641   | 177,680 | 素材             |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES        | 267    | 293    | 242     | 26,188  | 公益事業           |
| AIR CANADA                         | 65     | 76     | 132     | 14,350  | 資本財・サービス       |
| KINROSS GOLD CORP                  | 530    | 561    | 444     | 48,139  | 素材             |
| BANK OF MONTREAL                   | 273    | 328    | 3,611   | 390,776 | 金融             |
| POWER CORP OF CANADA               | 222    | 266    | 992     | 107,450 | 金融             |
| SHOPIFY INC - CLASS A              | 463    | 552    | 5,504   | 595,646 | 情報技術           |
| NUTRIEN LTD                        | 223.19 | 231.19 | 1,744   | 188,803 | 素材             |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A         | 53     | 63     | 227     | 24,623  | 公益事業           |
| CAMECO CORP                        | 158    | 200    | 1,201   | 130,025 | エネルギー          |
| FIRSTSERVICE CORP                  | 15     | 18     | 382     | 41,345  | 不動産            |

| 銘柄                           |  | 期首       | 当         | 期末          |           | 業種等            |
|------------------------------|--|----------|-----------|-------------|-----------|----------------|
|                              |  | 株数       | 株数        | 評価額         |           |                |
|                              |  |          |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                |
|                              |  | 百株       | 百株        | 千カナダ・ドル     | 千円        |                |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT |  | 71       | 108       | 403         | 43,626    | 資本財・サービス       |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC      |  | 53       | —         | —           | —         | 情報技術           |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG   |  | 26       | 26        | 73          | 7,905     | 金融             |
| TELUS CORP                   |  | 108      | 108       | 257         | 27,884    | コミュニケーション・サービス |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     |  | 194      | 209       | 1,053       | 113,984   | 素材             |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   |  | 22       | 24        | 337         | 36,491    | 一般消費財・サービス     |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   |  | 466      | 509       | 4,590       | 496,701   | エネルギー          |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  |  | 10       | 10        | 1,229       | 133,027   | 金融             |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      |  | 113      | 125       | 921         | 99,729    | 一般消費財・サービス     |
| WESTON (GEORGE) LTD          |  | 29.37    | 31.37     | 508         | 55,049    | 生活必需品          |
| PAN AMERICAN SILVER CORP     |  | 78       | 170       | 361         | 39,146    | 素材             |
| BLACKBERRY LTD               |  | 224      | —         | —           | —         | 情報技術           |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE    |  | —        | 38        | 417         | 45,182    | 情報技術           |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       |  | 238      | 270       | 1,846       | 199,783   | 金融             |
| ENBRIDGE INC                 |  | 821      | 931       | 4,368       | 472,688   | エネルギー          |
| BROOKFIELD CORP              |  | 571.25   | 647.25    | 3,130       | 338,708   | 金融             |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      |  | 780      | 846       | 2,219       | 240,215   | 金融             |
| BAUSCH HEALTH COS INC        |  | 113      | —         | —           | —         | ヘルスケア          |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY |  | 377.2    | 428.2     | 4,151       | 449,222   | 資本財・サービス       |
| IA FINANCIAL CORP INC        |  | 44       | 47        | 418         | 45,315    | 金融             |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        |  | 75       | 83        | 403         | 43,667    | 一般消費財・サービス     |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     |  | 237.5    | 259.5     | 4,036       | 436,735   | 資本財・サービス       |
| CGI INC - CLASS A            |  | 87       | 97        | 1,329       | 143,852   | 情報技術           |
| ONEX CORPORATION             |  | 29       | 32        | 298         | 32,265    | 金融             |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    |  | 190      | —         | —           | —         | コミュニケーション・サービス |
| IGM FINANCIAL INC            |  | 31       | 36        | 120         | 13,050    | 金融             |
| TMX GROUP LTD                |  | 23       | 125       | 358         | 38,820    | 金融             |
| OPEN TEXT CORP               |  | 110      | 121       | 669         | 72,445    | 情報技術           |
| SAPUTO INC                   |  | 102      | 117       | 304         | 32,980    | 生活必需品          |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   |  | 233      | 271       | 307         | 33,313    | 素材             |
| FORTIS INC                   |  | 193      | 223       | 1,212       | 131,175   | 公益事業           |
| RB GLOBAL INC                |  | 44       | 84        | 721         | 78,061    | 資本財・サービス       |
| LUNDIN MINING CORP           |  | 246      | 304       | 283         | 30,626    | 素材             |
| CENOVUS ENERGY INC           |  | 555      | 659       | 1,582       | 171,216   | エネルギー          |
| DOLLARAMA INC                |  | 112      | 128       | 1,246       | 134,907   | 一般消費財・サービス     |
| ALTAGAS LTD                  |  | 111      | 130       | 351         | 38,037    | 公益事業           |
| KEYERA CORP                  |  | 88       | 102       | 336         | 36,412    | エネルギー          |
| ARC RESOURCES LTD            |  | 286      | 286       | 620         | 67,095    | エネルギー          |
| カナダ・ドル通貨計                    |  | 株数、金額    | 16,476.16 | 18,563.26   | 111,713   | 12,088,466     |
|                              |  | 銘柄数<比率>  | 86銘柄      | 86銘柄        | <2.9%>    |                |
| (オーストラリア)                    |  | 百株       | 百株        | 千オーストラリア・ドル | 千円        |                |
| THE LOTTERY CORPORATION LTD  |  | 849.5    | 1,006.4   | 458         | 44,721    | 一般消費財・サービス     |
| TELSTRA GROUP LTD            |  | 1,563.94 | 1,823.47  | 689         | 67,169    | コミュニケーション・サービス |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD       |  | —        | 1,355.6   | 3,277       | 319,425   | 金融             |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         |  | 1,050.94 | 1,247.81  | 426         | 41,586    | 金融             |
| BHP GROUP LTD                |  | 1,973.18 | 2,285.01  | 10,554      | 1,028,532 | 素材             |
| SOUTH32 LTD                  |  | 1,770.77 | 2,056.49  | 629         | 61,323    | 素材             |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD    |  | 740.59   | 856.46    | 2,655       | 258,732   | エネルギー          |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   |  | 660.05   | 763.85    | 1,892       | 184,455   | 素材             |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  |  | 1,250.31 | 1,416.29  | 3,979       | 387,829   | 金融             |
| WESTPAC BANKING CORP         |  | 1,362.77 | 1,582.75  | 3,347       | 326,215   | 金融             |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘 柄                          |               | 期 首      | 当         | 期 末         |           | 業 種 等          |
|------------------------------|---------------|----------|-----------|-------------|-----------|----------------|
|                              |               | 株 数      | 株 数       | 評 価 額       |           |                |
|                              |               |          |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                |
|                              |               | 百株       | 百株        | 千オーストラリア・ドル | 千円        |                |
| SANTOS LTD                   |               | 1,254.13 | 1,449.25  | 1,005       | 98,013    | エネルギー          |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    |               | 1,168.89 | —         | —           | —         | 金融             |
| RIO TINTO LTD                |               | 144.67   | 167.44    | 2,085       | 203,277   | 素材             |
| ORIGIN ENERGY LTD            |               | 688.87   | 752.81    | 632         | 61,623    | 公益事業           |
| AURIZON HOLDINGS LTD         |               | 676      | 838.43    | 297         | 29,005    | 資本財・サービス       |
| PILBARA MINERALS LTD         |               | —        | 1,224.21  | 435         | 42,470    | 素材             |
| XERO LTD                     |               | 51.35    | 64.82     | 661         | 64,480    | 情報技術           |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON |               | 79       | 103.88    | 347         | 33,912    | 金融             |
| COLES GROUP LTD              |               | 520.8    | 603.47    | 917         | 89,388    | 生活必需品          |
| WISETECH GLOBAL LTD          |               | 54       | 73.81     | 487         | 47,472    | 情報技術           |
| IDP EDUCATION LTD            |               | 79       | 111.69    | 255         | 24,913    | 一般消費財・サービス     |
| IGO LTD                      |               | —        | 304.05    | 259         | 25,274    | 素材             |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD  |               | 445.84   | 519.49    | 658         | 64,140    | 素材             |
| EVOLUTION MINING LTD         |               | 656      | —         | —           | —         | 素材             |
| REECE LTD                    |               | 105      | 105       | 197         | 19,277    | 資本財・サービス       |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI |               | 512.6    | 649.15    | 317         | 30,933    | 生活必需品          |
| SEEK LTD                     |               | 128.45   | 162.68    | 380         | 37,064    | コミュニケーション・サービス |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    |               | 275.29   | 309.76    | 328         | 32,057    | 生活必需品          |
| NEWCREST MINING LTD          |               | 340.97   | —         | —           | —         | 素材             |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL |               | 665.19   | 755.26    | 7,804       | 760,509   | 金融             |
| AMPOL LTD                    |               | 88       | 104.54    | 357         | 34,790    | エネルギー          |
| ORICA LTD                    |               | 177.51   | 194.99    | 301         | 29,395    | 素材             |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      |               | 562.69   | 672.99    | 1,020       | 99,489    | 金融             |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         |               | 473.31   | 549.7     | 1,884       | 183,632   | 生活必需品          |
| QANTAS AIRWAYS LTD           |               | 354.69   | 390.82    | 203         | 19,804    | 資本財・サービス       |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  |               | 174.15   | 199.14    | 946         | 92,276    | 素材             |
| MACQUARIE GROUP LTD          |               | 141.98   | 165.61    | 2,742       | 267,224   | 金融             |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       |               | 229.09   | 265.26    | 1,068       | 104,173   | 一般消費財・サービス     |
| CSL LTD                      |               | 187.75   | 217.58    | 5,704       | 555,947   | ヘルスケア          |
| WESFARMERS LTD               |               | 442.06   | 511.74    | 2,697       | 262,909   | 一般消費財・サービス     |
| COCHLEAR LTD                 |               | 25.1     | 29.68     | 792         | 77,224    | ヘルスケア          |
| BLUESCOPE STEEL LTD          |               | 178      | 206.66    | 419         | 40,902    | 素材             |
| SUNCORP GROUP LTD            |               | 480.15   | 572.84    | 780         | 76,087    | 金融             |
| ASX LTD                      |               | 73.65    | 87.54     | 508         | 49,546    | 金融             |
| COMPUTERSHARE LTD            |               | 206.89   | 251.69    | 585         | 57,099    | 資本財・サービス       |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    |               | 964.1    | 1,104.68  | 636         | 62,007    | 金融             |
| SONIC HEALTHCARE LTD         |               | 173.28   | 195.99    | 566         | 55,215    | ヘルスケア          |
| BRAMBLES LTD                 |               | 561.58   | 626.38    | 818         | 79,719    | 資本財・サービス       |
| MINERAL RESOURCES LTD        |               | 66.66    | 76.02     | 465         | 45,360    | 素材             |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       |               | 69.73    | 82.91     | 406         | 39,589    | ヘルスケア          |
| REA GROUP LTD                |               | 20.23    | 23.95     | 379         | 36,978    | コミュニケーション・サービス |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L |               | 22       | —         | —           | —         | 一般消費財・サービス     |
| オーストラリア・ドル通貨計                | 株 数、金 額       | 24,740.7 | 29,120.04 | 68,272      | 6,653,182 |                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 49 銘柄    | 48 銘柄     |             | <1.6%>    |                |
| (香港)                         |               | 百株       | 百株        | 千香港・ドル      | 千円        |                |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    |               | 580      | 720       | 2,869       | 54,055    | 公益事業           |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L |               | 940      | 1,140     | 4,588       | 86,447    | 一般消費財・サービス     |
| MTR CORP                     |               | 665      | 810       | 2,276       | 42,881    | 資本財・サービス       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      |               | 605      | 755       | 5,768       | 108,672   | 不動産            |
| SINO LAND CO                 |               | 1,420    | 1,820     | 1,414       | 26,642    | 不動産            |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    |               | 1,116.69 | 1,396.69  | 5,468       | 103,017   | 資本財・サービス       |

| 銘柄                           |            | 期首          | 当           | 期末           |             | 業種等            |
|------------------------------|------------|-------------|-------------|--------------|-------------|----------------|
|                              |            | 株数          | 株数          | 評価額          |             |                |
|                              |            |             |             | 外貨建金額        | 邦貨換算金額      |                |
|                              |            | 百株          | 百株          | 千香港・ドル       | 千円          |                |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     |            | 215         | 240         | 1, 224       | 23, 060     | 不動産            |
| CLP HOLDINGS LTD             |            | 700         | 855         | 5, 164       | 97, 293     | 公益事業           |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   |            | 595. 07     | 755. 07     | 1, 604       | 30, 229     | 不動産            |
| HONG KONG & CHINA GAS        |            | 4, 824. 75  | 5, 824. 75  | 3, 087       | 58, 161     | 公益事業           |
| HANG SENG BANK LTD           |            | 329         | 398         | 3, 482       | 65, 610     | 金融             |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        |            | 635         | 795         | 931          | 17, 553     | 不動産            |
| WH GROUP LTD                 |            | 3, 610      | 4, 335      | 2, 128       | 40, 100     | 生活必需品          |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  |            | 511         | 626         | 17, 502      | 329, 755    | 金融             |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     |            | 870         | 970         | 1, 028       | 19, 371     | 不動産            |
| XINYI GLASS HOLDINGS LTD     |            | 780         | 870         | 773          | 14, 571     | 資本財・サービス       |
| SWIRE PROPERTIES LTD         |            | 450         | 608         | 924          | 17, 411     | 不動産            |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        |            | 911. 69     | 1, 026. 69  | 3, 916       | 73, 792     | 不動産            |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L |            | 265         | 300         | 1, 143       | 21, 534     | 公益事業           |
| AIA GROUP LTD                |            | 5, 096      | 6, 006      | 41, 561      | 783, 019    | 金融             |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS  |            | 540         | 640         | 783          | 14, 758     | 資本財・サービス       |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT |            | 720         | 870         | 2, 170       | 40, 895     | 不動産            |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT |            | 741         | 895         | 1, 218       | 22, 965     | 生活必需品          |
| ESR CAYMAN LTD               |            | 862         | 1, 138      | 1, 138       | 21, 439     | 不動産            |
| SANDS CHINA LTD              |            | 1, 044      | 1, 264      | 2, 406       | 45, 341     | 一般消費財・サービス     |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU |            | 820         | —           | —            | —           | 一般消費財・サービス     |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD |            | 575         | 715         | 5, 716       | 107, 697    | 資本財・サービス       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   |            | 1, 590      | 1, 925      | 4, 052       | 76, 342     | 金融             |
| 香港・ドル通貨計                     | 株数、金額      | 32, 011. 2  | 37, 698. 2  | 124, 343     | 2, 342, 622 |                |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 28 銘柄       | 27 銘柄       |              | <0. 6% >    |                |
| (シンガポール)                     |            | 百株          | 百株          | 千シンガポール・ドル   | 千円          |                |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD    |            | 1, 074      | 1, 353      | 414          | 45, 699     | 不動産            |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     |            | 508         | 657         | 1, 794       | 198, 123    | 金融             |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       |            | 779         | 942         | 2, 991       | 330, 234    | 金融             |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       |            | 539. 75     | 773. 75     | 492          | 54, 403     | 資本財・サービス       |
| KEPPEL CORP LTD              |            | 627         | 757         | 486          | 53, 727     | 資本財・サービス       |
| UOL GROUP LTD                |            | 200         | 229         | 136          | 15, 014     | 不動産            |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        |            | 161         | 246         | 153          | 16, 916     | 不動産            |
| SEATRUM                      |            | —           | 23, 060. 22 | 246          | 27, 235     | 資本財・サービス       |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD |            | —           | 51          | 147          | 16, 325     | 資本財・サービス       |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP |            | 1, 457      | 1, 761      | 2, 234       | 246, 667    | 金融             |
| GENTING SINGAPORE LTD        |            | 2, 380      | 3, 144      | 286          | 31, 580     | 一般消費財・サービス     |
| VENTURE CORP LTD             |            | 112         | —           | —            | —           | 情報技術           |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS |            | 3, 553. 5   | 4, 293. 5   | 983          | 108, 526    | コミュニケーション・サービス |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   |            | 627         | 812         | 302          | 33, 341     | 資本財・サービス       |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      |            | —           | 465         | 239          | 26, 484     | 公益事業           |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       |            | 357         | 446         | 426          | 47, 063     | 金融             |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     |            | 800         | 999         | 367          | 40, 579     | 生活必需品          |
| シンガポール・ドル通貨計                 | 株数、金額      | 13, 175. 25 | 39, 989. 47 | 11, 704      | 1, 291, 923 |                |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 14 銘柄       | 16 銘柄       |              | <0. 3% >    |                |
| (ニュージーランド)                   |            | 百株          | 百株          | 千ニュージーランド・ドル | 千円          |                |
| MERIDIAN ENERGY LTD          |            | 525         | 671. 52     | 344          | 31, 245     | 公益事業           |
| MERCURY NZ LTD               |            | 300         | 341. 43     | 207          | 18, 828     | 公益事業           |
| EBOS GROUP LTD               |            | —           | 76. 6       | 283          | 25, 699     | ヘルスケア          |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        |            | 805. 3      | 921. 47     | 467          | 42, 373     | コミュニケーション・サービス |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                                        |         | 期首                  | 当                      | 期末                         |                        | 業種等               |
|-----------------------------------------------------------|---------|---------------------|------------------------|----------------------------|------------------------|-------------------|
|                                                           |         | 株数                  | 株数                     | 評価額                        |                        |                   |
|                                                           |         |                     |                        | 外貨建金額                      | 邦貨換算金額                 |                   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD<br>FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C |         | 百株<br>521.13<br>242 | 百株<br>650.88<br>301.25 | 千ニュージーランド・ドル<br>514<br>716 | 千円<br>46,637<br>65,029 | 資本財・サービス<br>ヘルスケア |
| ニュージーランド・ドル通貨計                                            | 株数、金額   | 2,393.43            | 2,963.15               | 2,533                      | 229,813                |                   |
|                                                           | 銘柄数＜比率＞ | 5銘柄                 | 6銘柄                    |                            | <0.1%>                 |                   |
| (イギリス)                                                    |         | 百株                  | 百株                     | 千イギリス・ポンド                  | 千円                     |                   |
| SHELL PLC                                                 |         | 3,052.97            | 3,164.34               | 8,080                      | 1,509,693              | エネルギー             |
| HALEON PLC                                                |         | 2,041.62            | 2,644.82               | 875                        | 163,615                | 生活必需品             |
| WISE PLC CLASS A                                          |         | —                   | 302.73                 | 236                        | 44,186                 | 金融                |
| BP PLC                                                    |         | 7,881.77            | 8,188.83               | 3,864                      | 722,083                | エネルギー             |
| UNILEVER PLC                                              |         | 1,041.21            | 1,190.31               | 4,467                      | 834,769                | 生活必需品             |
| BARCLAYS PLC                                              |         | 6,832.63            | 7,366.15               | 1,033                      | 193,093                | 金融                |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC                                  |         | 3,363.9             | 3,987.38               | 1,050                      | 196,233                | 資本財・サービス          |
| PRUDENTIAL PLC                                            |         | 1,122.04            | 1,303.55               | 1,113                      | 208,044                | 金融                |
| NATWEST GROUP PLC                                         |         | 2,183.95            | 2,753.93               | 568                        | 106,201                | 金融                |
| JOHNSON MATTHEY PLC                                       |         | 70.64               | 83.88                  | 134                        | 25,177                 | 素材                |
| BAE SYSTEMS PLC                                           |         | 1,288.2             | 1,443.09               | 1,493                      | 279,063                | 資本財・サービス          |
| AVIVA PLC                                                 |         | 1,156.48            | 1,270.14               | 527                        | 98,627                 | 金融                |
| AVEVA GROUP PLC                                           |         | 49.48               | —                      | —                          | —                      | 情報技術              |
| GSK                                                       |         | 1,659.76            | 1,938.76               | 2,716                      | 507,495                | ヘルスケア             |
| INFORMA PLC                                               |         | 600.95              | 663.43                 | 489                        | 91,478                 | コミュニケーション・サービス    |
| MELROSE INDUSTRIES PLC                                    |         | 1,787.92            | 702.66                 | 367                        | 68,662                 | 資本財・サービス          |
| AUTO TRADER GROUP PLC                                     |         | 380.02              | 435.78                 | 312                        | 58,476                 | コミュニケーション・サービス    |
| DCC PLC                                                   |         | 39.64               | 46.96                  | 251                        | 47,046                 | 資本財・サービス          |
| OCADO GROUP PLC                                           |         | 238.27              | 276.77                 | 164                        | 30,696                 | 生活必需品             |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC                              |         | 29                  | 35.02                  | 321                        | 60,039                 | 資本財・サービス          |
| HALMA PLC                                                 |         | 152.6               | 180.19                 | 382                        | 71,508                 | 情報技術              |
| ENTAIN PLC                                                |         | 240.59              | 304.69                 | 243                        | 45,554                 | 一般消費財・サービス        |
| JD SPORTS FASHION PLC                                     |         | 997                 | 1,232.36               | 193                        | 36,218                 | 一般消費財・サービス        |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC                                |         | 301.68              | 357.03                 | 165                        | 30,932                 | 金融                |
| M&G PLC                                                   |         | 1,045.04            | 1,045.04               | 219                        | 41,081                 | 金融                |
| ENDEAVOUR MINING PLC                                      |         | —                   | 91.41                  | 167                        | 31,322                 | 素材                |
| RELX PLC                                                  |         | 785.4               | 896.22                 | 2,729                      | 510,051                | 資本財・サービス          |
| DIAGEO PLC                                                |         | 932.76              | 1,063.61               | 2,914                      | 544,506                | 生活必需品             |
| RIO TINTO PLC                                             |         | 458.86              | 533.07                 | 2,878                      | 537,833                | 素材                |
| STANDARD CHARTERED PLC                                    |         | 1,046.59            | 1,122.54               | 718                        | 134,314                | 金融                |
| TESCO PLC                                                 |         | 3,063.36            | 3,387.02               | 963                        | 179,977                | 生活必需品             |
| SMITH & NEPHEW PLC                                        |         | 353.11              | 413.44                 | 422                        | 78,907                 | ヘルスケア             |
| GLENCORE PLC                                              |         | 4,022.88            | 4,978.95               | 2,210                      | 412,992                | 素材                |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC                                   |         | 132.5               | 169.56                 | 120                        | 22,505                 | 金融                |
| SMITHS GROUP PLC                                          |         | 153.83              | 166.14                 | 271                        | 50,799                 | 資本財・サービス          |
| PEARSON PLC                                               |         | 283.63              | 306.19                 | 283                        | 53,055                 | 一般消費財・サービス        |
| SAINSBURY (J) PLC                                         |         | 718.64              | 782.74                 | 221                        | 41,461                 | 生活必需品             |
| NEXT PLC                                                  |         | 53.11               | 56.2                   | 445                        | 83,268                 | 一般消費財・サービス        |
| TAYLOR WIMPEY PLC                                         |         | 1,466.73            | 1,676.29               | 216                        | 40,433                 | 一般消費財・サービス        |
| WHITBREAD PLC                                             |         | 81.27               | 92.18                  | 286                        | 53,563                 | 一般消費財・サービス        |
| BUNZL PLC                                                 |         | 135.62              | 159.99                 | 470                        | 87,973                 | 資本財・サービス          |
| VODAFONE GROUP PLC                                        |         | 10,810.03           | 11,455.92              | 811                        | 151,563                | コミュニケーション・サービス    |
| CRODA INTERNATIONAL PLC                                   |         | 56.01               | 66.27                  | 294                        | 55,099                 | 素材                |
| KINGFISHER PLC                                            |         | 787.11              | 857.79                 | 188                        | 35,275                 | 一般消費財・サービス        |
| WPP PLC                                                   |         | 458.47              | 508.89                 | 357                        | 66,841                 | コミュニケーション・サービス    |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC                                |         | 278.81              | 322.8                  | 363                        | 67,850                 | 公益事業              |
| SEVERN TRENT PLC                                          |         | 102.32              | 119.46                 | 324                        | 60,620                 | 公益事業              |

| 銘柄                                |         | 期首         | 当          | 期末          |            | 業種等            |
|-----------------------------------|---------|------------|------------|-------------|------------|----------------|
|                                   |         | 株数         | 株数         | 評価額         |            |                |
|                                   |         |            |            | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |                |
|                                   |         | 百株         | 百株         | 千イギリス・ポンド   | 千円         |                |
| RENTOKIL INITIAL PLC              |         | 747.06     | 1,193.17   | 518         | 96,886     | 資本財・サービス       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       |         | 291.82     | 339.78     | 1,831       | 342,181    | 生活必需品          |
| ST JAMES'S PLACE PLC              |         | 217.32     | 260.55     | 168         | 31,516     | 金融             |
| SCHRODERS PLC                     |         | 273.52     | 398.15     | 159         | 29,830     | 金融             |
| SSE PLC                           |         | 435.75     | 516.22     | 944         | 176,552    | 公益事業           |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC          |         | 395        | 462.6      | 235         | 43,924     | 一般消費財・サービス     |
| ASTRAZENECA PLC                   |         | 632.33     | 733.82     | 7,361       | 1,375,456  | ヘルスケア          |
| FERGUSON PLC                      |         | 87.77      | —          | —           | —          | 資本財・サービス       |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC         |         | 2,396.89   | 2,830.52   | 646         | 120,843    | 金融             |
| 3i GROUP PLC                      |         | 390.73     | 460.84     | 1,028       | 192,096    | 金融             |
| ASHTREAD GROUP PLC                |         | 178.54     | 207.46     | 982         | 183,498    | 資本財・サービス       |
| SAGE GROUP PLC/THE                |         | 401.14     | 485.36     | 548         | 102,473    | 情報技術           |
| NATIONAL GRID PLC                 |         | 1,488.17   | 1,743.49   | 1,787       | 334,060    | 公益事業           |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC          |         | 28,500.13  | 30,160.79  | 1,310       | 244,851    | 金融             |
| IMPERIAL BRANDS PLC               |         | 381.61     | 408.12     | 748         | 139,886    | 生活必需品          |
| CRH PLC                           |         | —          | 339.42     | 1,670       | 312,203    | 素材             |
| CENTRICA PLC                      |         | —          | 2,799.88   | 412         | 77,109     | 公益事業           |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC |         | 42.32      | 49.18      | 228         | 42,691     | 一般消費財・サービス     |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC      |         | 878.5      | 1,005.93   | 2,529       | 472,595    | 生活必需品          |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC      |         | 138        | 164.69     | 393         | 73,480     | 生活必需品          |
| HSBC HOLDINGS PLC                 |         | 8,199.21   | 9,349.51   | 5,561       | 1,039,033  | 金融             |
| ANGLO AMERICAN PLC                |         | 518.56     | 601.64     | 1,286       | 240,389    | 素材             |
| MONDI PLC                         |         | 198.53     | 229.86     | 321         | 60,125     | 素材             |
| COMPASS GROUP PLC                 |         | 728        | 820.31     | 1,654       | 309,138    | 一般消費財・サービス     |
| PERSIMMON PLC                     |         | 128.32     | 151.88     | 191         | 35,726     | 一般消費財・サービス     |
| BT GROUP PLC                      |         | 3,453      | 3,453      | 423         | 79,064     | コミュニケーション・サービス |
| COCA-COLA HBC AG-DI               |         | 78         | 101.36     | 220         | 41,266     | 生活必需品          |
| BURBERRY GROUP PLC                |         | 160.61     | 178.7      | 259         | 48,413     | 一般消費財・サービス     |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU      |         | 75.23      | 80.05      | 489         | 91,474     | 一般消費財・サービス     |
| INTERTEK GROUP PLC                |         | 64.81      | 76.6       | 305         | 57,018     | 資本財・サービス       |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP       |         | 134.5      | 188.86     | 1,682       | 314,403    | 金融             |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC         |         | 66         | 78.66      | 135         | 25,315     | ヘルスケア          |
| ADMIRAL GROUP PLC                 |         | 75         | 97.79      | 264         | 49,386     | 金融             |
| ANTOFAGASTA PLC                   |         | 153        | 187.17     | 265         | 49,606     | 素材             |
| ABRDN PLC                         |         | 843.62     | 908.62     | 151         | 28,384     | 金融             |
| EXPERIAN PLC                      |         | 375.75     | 435.65     | 1,271       | 237,515    | 資本財・サービス       |
| イギリス・ポンド通貨計                       | 株数、金額   | 116,867.14 | 131,644.15 | 84,931      | 15,868,602 |                |
|                                   | 銘柄数<比率> | 79銘柄       | 81銘柄       |             | <3.8%>     |                |
| (イスラエル)                           |         | 百株         | 百株         | 千イスラエル・シェケル | 千円         |                |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A            |         | 514.98     | 643.14     | 1,191       | 47,566     | 金融             |
| AZRIELI GROUP LTD                 |         | 18.26      | 22.07      | 489         | 19,529     | 不動産            |
| TOWER SEMICONDUCTOR LTD           |         | 45.41      | —          | —           | —          | 情報技術           |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO      |         | 890        | —          | —           | —          | コミュニケーション・サービス |
| ICL GROUP LTD                     |         | 304.61     | 380.9      | 740         | 29,539     | 素材             |
| ELBIT SYSTEMS LTD                 |         | 11         | 13.83      | 1,049       | 41,902     | 資本財・サービス       |
| BANK HAPOALIM BM                  |         | 546.45     | 660.5      | 2,113       | 84,360     | 金融             |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL              |         | 664.26     | 798.01     | 2,298       | 91,731     | 金融             |
| NICE LTD                          |         | 27.31      | 32.9       | 2,361       | 94,257     | 情報技術           |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD          |         | 64.07      | 80.29      | 1,095       | 43,711     | 金融             |
| イスラエル・シェケル通貨計                     | 株数、金額   | 3,086.35   | 2,631.64   | 11,339      | 452,599    |                |
|                                   | 銘柄数<比率> | 10銘柄       | 8銘柄        |             | <0.1%>     |                |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           |               | 期 首        | 当          | 期 末         |              | 業 種 等          |
|------------------------------|---------------|------------|------------|-------------|--------------|----------------|
|                              |               | 株 数        | 株 数        | 評 価 額       |              |                |
|                              |               |            |            | 外貨建金額       | 邦貨換算金額       |                |
|                              |               | 百株         | 百株         | 千スイス・フラン    | 千円           |                |
| (スイス)                        |               |            |            |             |              |                |
| CS GROUP ANR RIGHTS AG       |               | 1, 040. 49 | —          | —           | —            | 金融             |
| SANDOZ GROUP AG              |               | —          | 189. 4     | 492         | 82, 941      | ヘルスケア          |
| AVOLTA AG                    |               | —          | 48. 54     | 149         | 25, 257      | 一般消費財・サービス     |
| UBS GROUP AG-REG             |               | 1, 404. 83 | 1, 526. 27 | 3, 647      | 614, 870     | 金融             |
| ROCHE HOLDING AG-BR          |               | 11. 8      | 14. 47     | 360         | 60, 781      | ヘルスケア          |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    |               | 2. 8       | 3. 26      | 200         | 33, 767      | 素材             |
| ADECCO GROUP AG-REG          |               | 63. 6      | 74. 58     | 313         | 52, 824      | 資本財・サービス       |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN |               | 280. 61    | 325. 81    | 7, 702      | 1, 298, 274  | ヘルスケア          |
| SIKA AG-REG                  |               | 58. 34     | 67. 89     | 1, 607      | 270, 982     | 素材             |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  |               | 0. 04      | 0. 05      | 537         | 90, 516      | 生活必需品          |
| ABB LTD-REG                  |               | 656. 05    | 743. 42    | 2, 534      | 427, 184     | 資本財・サービス       |
| SWISS RE AG                  |               | 120. 47    | 139. 88    | 1, 437      | 242, 265     | 金融             |
| NESTLE SA-REG                |               | 1, 124. 33 | 1, 233. 71 | 12, 229     | 2, 061, 449  | 生活必需品          |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    |               | 9          | 10. 52     | 1, 203      | 202, 859     | 金融             |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  |               | 16. 01     | 18. 93     | 371         | 62, 588      | 資本財・サービス       |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   |               | 1, 040. 49 | —          | —           | —            | 金融             |
| JULIUS BAER GROUP LTD        |               | 87. 08     | 95. 36     | 413         | 69, 760      | 金融             |
| SGS SA-REG                   |               | 2. 52      | 69. 25     | 515         | 86, 938      | 資本財・サービス       |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     |               | 9. 34      | 10. 91     | 203         | 34, 315      | 資本財・サービス       |
| TEMENOS AG - REG             |               | 25         | 29. 73     | 216         | 36, 542      | 情報技術           |
| HELVETIA HOLDING AG-REG      |               | —          | 18. 28     | 215         | 36, 389      | 金融             |
| VAT GROUP AG                 |               | 10. 5      | 12. 55     | 488         | 82, 290      | 資本財・サービス       |
| BKW AG                       |               | —          | 9. 42      | 142         | 23, 960      | 公益事業           |
| ALCON INC                    |               | 199. 59    | 231. 73    | 1, 515      | 255, 533     | ヘルスケア          |
| SIG GROUP N AG               |               | 130        | 141. 78    | 287         | 48, 418      | 素材             |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       |               | 11. 59     | 13. 42     | 308         | 51, 982      | 一般消費財・サービス     |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    |               | 60. 1      | 69. 77     | 3, 038      | 512, 166     | 金融             |
| BALOISE HOLDING AG - REG     |               | 18         | 21. 34     | 276         | 46, 689      | 金融             |
| CLARIANT AG-REG              |               | 86. 78     | 96. 78     | 126         | 21, 321      | 素材             |
| NOVARTIS AG-REG              |               | 863. 2     | 947. 01    | 8, 034      | 1, 354, 283  | ヘルスケア          |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       |               | 1. 41      | 1. 59      | 231         | 38, 941      | 生活必需品          |
| BACHEM HOLDING AG-REG B      |               | 12. 5      | 15. 75     | 103         | 17, 468      | ヘルスケア          |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG |               | 208. 49    | 242. 07    | 2, 650      | 446, 796     | 一般消費財・サービス     |
| SWISSCOM AG-REG              |               | 10. 36     | 12. 01     | 614         | 103, 528     | コミュニケーション・サービス |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG |               | —          | 13. 44     | 142         | 24, 036      | 金融             |
| GEBERIT AG-REG               |               | 14. 33     | 15. 59     | 758         | 127, 818     | 資本財・サービス       |
| GIVAUDAN-REG                 |               | 3. 69      | 4. 28      | 1, 388      | 234, 106     | 素材             |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     |               | 43. 89     | 51. 76     | 631         | 106, 440     | ヘルスケア          |
| SONOVA HOLDING AG-REG        |               | 21. 1      | 24. 15     | 608         | 102, 500     | ヘルスケア          |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG   |               | 69. 29     | 76. 19     | 571         | 96, 396      | 情報技術           |
| LONZA GROUP AG-REG           |               | 29. 74     | 34. 53     | 1, 180      | 198, 940     | ヘルスケア          |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      |               | 19         | 22. 69     | 99          | 16, 770      | 一般消費財・サービス     |
| HOLCIM LTD                   |               | 218. 29    | 246. 69    | 1, 576      | 265, 709     | 素材             |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    |               | 12. 37     | 13. 72     | 769         | 129, 739     | 金融             |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   |               | 21. 35     | 25. 19     | 645         | 108, 783     | 資本財・サービス       |
| SWISS PRIME SITE-REG         |               | 30. 25     | 35. 75     | 312         | 52, 607      | 不動産            |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   |               | 0. 42      | 0. 44      | 478         | 80, 693      | 生活必需品          |
| スイス・フラン通貨計                   | 株 数、 金 額      | 8, 049. 04 | 6, 999. 9  | 61, 333     | 10, 338, 437 |                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 42 銘柄      | 45 銘柄      |             | <2. 5%>      |                |
| (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           |               | 701. 05    | 1, 647. 16 | 113, 555    | 2, 459, 605  | ヘルスケア          |

| 銘柄                           |  | 期首                | 当        | 期末           |           | 業種等            |
|------------------------------|--|-------------------|----------|--------------|-----------|----------------|
|                              |  | 株数                | 株数       | 評価額          |           |                |
|                              |  |                   |          | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    |                |
|                              |  | 百株                | 百株       | 千デンマーク・クローネ  | 千円        |                |
| DANSKE BANK A/S              |  | 296.78            | 358.61   | 6,306        | 136,591   | 金融             |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A       |  | 1.31              | 1.53     | 1,638        | 35,492    | 資本財・サービス       |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      |  | 430.42            | 525.05   | 9,584        | 207,595   | 資本財・サービス       |
| GN STORE NORD A/S            |  | 54.65             | —        | —            | —         | 一般消費財・サービス     |
| CARLSBERG AS-B               |  | 41.8              | 51.2     | 4,236        | 91,757    | 生活必需品          |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       |  | 88                | 106.34   | 3,716        | 80,501    | 素材             |
| COLOPLAST-B                  |  | 51.12             | 61.77    | 4,961        | 107,463   | ヘルスケア          |
| DSV PANALPINA A/S            |  | 82.8              | 96.78    | 10,195       | 220,840   | 資本財・サービス       |
| ROCKWOOL INTL A/S-B SHS      |  | 3.7               | 4.26     | 777          | 16,839    | 資本財・サービス       |
| DEMANT A/S                   |  | 42.75             | 52.39    | 1,522        | 32,987    | ヘルスケア          |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       |  | 2.3               | 2.52     | 2,739        | 59,331    | 資本財・サービス       |
| TRYG A/S                     |  | 149.9             | 177.29   | 2,587        | 56,046    | 金融             |
| PANDORA A/S                  |  | 40                | 43.41    | 3,956        | 85,695    | 一般消費財・サービス     |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       |  | 43                | 54.84    | 2,931        | 63,501    | 素材             |
| GENMAB A/S                   |  | 28.29             | 34.33    | 7,353        | 159,276   | ヘルスケア          |
| ORSTED A/S                   |  | 81.4              | 98.35    | 3,107        | 67,316    | 公益事業           |
| デンマーク・クローネ通貨計                |  | 株数、金額<br>2,139.27 | 3,315.83 | 179,170      | 3,880,843 |                |
|                              |  | 銘柄数<比率><br>17銘柄   | 16銘柄     |              | <0.9%>    |                |
| (ノルウェー)                      |  | 百株                | 百株       | 千ノルウェー・クローネ  | 千円        |                |
| DNB BANK                     |  | 400.25            | 481.22   | 9,855        | 136,102   | 金融             |
| NORSK HYDRO ASA              |  | 578.66            | 689.82   | 4,350        | 60,073    | 素材             |
| ORKLA ASA                    |  | 323.17            | 390.5    | 3,120        | 43,099    | 生活必需品          |
| TELENOR ASA                  |  | 291.31            | 363.8    | 4,207        | 58,103    | コミュニケーション・サービス |
| EQUINOR ASA                  |  | 420.51            | 469.08   | 16,054       | 221,709   | エネルギー          |
| YARA INTERNATIONAL ASA       |  | 71.24             | 86.08    | 3,115        | 43,021    | 素材             |
| MOWI ASA                     |  | 178               | 228.53   | 4,393        | 60,674    | 生活必需品          |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    |  | 80.5              | 103.98   | 1,892        | 26,134    | 金融             |
| AKER BP ASA                  |  | 135.97            | 164.3    | 5,004        | 69,113    | エネルギー          |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA        |  | 37.23             | 45.73    | 2,124        | 29,340    | 資本財・サービス       |
| SALMAR ASA                   |  | 24.52             | 35.73    | 2,088        | 28,845    | 生活必需品          |
| ADEVINTA ASA                 |  | 120               | 139.44   | 1,553        | 21,451    | コミュニケーション・サービス |
| ノルウェー・クローネ通貨計                |  | 株数、金額<br>2,661.36 | 3,198.21 | 57,760       | 797,670   |                |
|                              |  | 銘柄数<比率><br>12銘柄   | 12銘柄     |              | <0.2%>    |                |
| (スウェーデン)                     |  | 百株                | 百株       | 千スウェーデン・クローネ | 千円        |                |
| SAGAX CLASS B                |  | 79.24             | 102.55   | 2,454        | 34,871    | 不動産            |
| INVESTOR CLASS A             |  | 214.58            | —        | —            | —         | 金融             |
| VOLVO CAR CLASS B            |  | 248.08            | 285.14   | 980          | 13,930    | 一般消費財・サービス     |
| ERICSSON LM-B SHS            |  | 1,255.88          | 1,522.46 | 8,005        | 113,752   | 情報技術           |
| VOLVO AB-B SHS               |  | 649.3             | 784.58   | 19,002       | 270,025   | 資本財・サービス       |
| SKF AB-B SHARES              |  | 164.95            | 177.19   | 3,464        | 49,224    | 資本財・サービス       |
| ELECTROLUX AB-SER B          |  | 86                | —        | —            | —         | 一般消費財・サービス     |
| SWEDISH MATCH AB             |  | 657.78            | —        | —            | —         | 生活必需品          |
| TELE2 AB-B SHS               |  | 244.23            | 263.33   | 2,156        | 30,646    | コミュニケーション・サービス |
| GETINGE AB-B SHS             |  | 92                | 118.92   | 2,686        | 38,173    | ヘルスケア          |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A |  | 700.28            | 825.04   | 10,461       | 148,658   | 金融             |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |  | 627.59            | 758.34   | 7,525        | 106,941   | 金融             |
| SWEDBANK AB - A SHARES       |  | 389.66            | 433.33   | 8,374        | 118,995   | 金融             |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    |  | 314.25            | 349.46   | 6,116        | 86,921    | 一般消費財・サービス     |
| SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B  |  | 260.69            | 315      | 5,021        | 71,349    | 素材             |
| SKANSKA AB-B SHS             |  | 146.38            | 176.89   | 2,975        | 42,278    | 資本財・サービス       |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                          |            | 期首        | 当         | 期末           |           | 業種等            |
|-----------------------------|------------|-----------|-----------|--------------|-----------|----------------|
|                             |            | 株数        | 株数        | 評価額          |           |                |
|                             |            |           |           | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    |                |
|                             |            | 百株        | 百株        | 千スウェーデン・クローネ | 千円        |                |
| SANDVIK AB                  |            | 457       | 554.35    | 11,330       | 161,012   | 資本財・サービス       |
| INVESTOR AB-B SHS           |            | 783.94    | 899.89    | 19,392       | 275,569   | 金融             |
| ATLAS COPCO AB-A SHS        |            | 1,155.75  | 1,396.53  | 22,588       | 320,987   | 資本財・サービス       |
| VOLVO AB-A SHS              |            | 80        | 104.11    | 2,554        | 36,304    | 資本財・サービス       |
| HOLMEN AB-B SHARES          |            | 39.06     | 48.77     | 2,148        | 30,534    | 素材             |
| SECURITAS AB-B SHS          |            | 119.5     | 255.7     | 2,373        | 33,733    | 資本財・サービス       |
| TELIA CO AB                 |            | 1,106.67  | 1,228.66  | 3,061        | 43,508    | コミュニケーション・サービス |
| ALFA LAVAL AB               |            | 127       | 150.43    | 5,863        | 83,324    | 資本財・サービス       |
| ATLAS COPCO AB-B SHS        |            | 671.61    | 811.53    | 11,251       | 159,888   | 資本財・サービス       |
| ASSA ABLOY AB-B             |            | 431.26    | 521.11    | 14,049       | 199,638   | 資本財・サービス       |
| SAAB AB-B                   |            | —         | 39.43     | 2,159        | 30,682    | 資本財・サービス       |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS     |            | 52.43     | 67.68     | 2,131        | 30,284    | 金融             |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS |            | 262.68    | 301.92    | 1,896        | 26,951    | 不動産            |
| INDUTRADE AB                |            | 113.71    | 134.54    | 3,098        | 44,029    | 資本財・サービス       |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB |            | 70.32     | 101.25    | 2,555        | 36,314    | ヘルスケア          |
| LUNDBERGS AB-B SHS          |            | 30        | 39.51     | 1,967        | 27,965    | 金融             |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS  |            | 57        | 68.43     | 1,593        | 22,646    | 資本財・サービス       |
| LIFCO AB-B SHS              |            | 95        | 121.2     | 2,777        | 39,474    | 資本財・サービス       |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS    |            | 652.08    | 787.93    | 4,930        | 70,067    | 資本財・サービス       |
| BEIJER REF AB               |            | —         | 200.12    | 2,343        | 33,299    | 資本財・サービス       |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B         |            | 262.04    | 316.69    | 8,341        | 118,534   | 生活必需品          |
| EMBRACER GROUP AB           |            | 265.94    | —         | —            | —         | コミュニケーション・サービス |
| BOLIDEN AB                  |            | 113.87    | 142.2     | 4,043        | 57,457    | 素材             |
| EPIROC AB-A                 |            | 274.36    | 342.63    | 6,647        | 94,454    | 資本財・サービス       |
| EPIROC AB-B                 |            | 167.8     | 192.02    | 3,166        | 44,994    | 資本財・サービス       |
| HUSQVARNA AB-B SHS          |            | 170.5     | 193.95    | 1,557        | 22,130    | 資本財・サービス       |
| NORDEA BANK ABP             |            | 1,467.48  | 1,674.88  | 19,579       | 278,222   | 金融             |
| EQT AB                      |            | 123.18    | 184.89    | 4,600        | 65,366    | 金融             |
| EVOLUTION AB                |            | 78.67     | 95.28     | 10,497       | 149,175   | 一般消費財・サービス     |
| KINNEVIK AB - B             |            | 104.31    | —         | —            | —         | 金融             |
| HEXAGON AB-B SHS            |            | 837.5     | 1,079.44  | 11,280       | 160,290   | 情報技術           |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS     |            | 62        | 80.28     | 2,526        | 35,900    | 金融             |
| スウェーデン・クローネ通貨計              | 株数、金額      | 16,363.55 | 18,247.58 | 271,535      | 3,858,515 |                |
|                             | 銘柄数 < 比率 > | 46 銘柄     | 43 銘柄     |              | <0.9%>    |                |
| ユーロ (アイルランド)                |            | 百株        | 百株        | 千ユーロ         | 千円        |                |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     |            | 99.48     | 121.88    | 404          | 65,255    | 素材             |
| AIB GROUP PLC               |            | —         | 679.31    | 281          | 45,509    | 金融             |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC   |            | —         | 495.16    | 424          | 68,569    | 金融             |
| KINGSPAN GROUP PLC          |            | 60.76     | 72.49     | 516          | 83,477    | 資本財・サービス       |
| KERRY GROUP PLC-A           |            | 62.72     | 74.71     | 551          | 89,025    | 生活必需品          |
| CRH PLC                     |            | 306.32    | —         | —            | —         | 素材             |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC   |            | 67.04     | 82.75     | 1,189        | 192,121   | 一般消費財・サービス     |
| 国小計                         | 株数、金額      | 596.32    | 1,526.3   | 3,367        | 543,958   |                |
|                             | 銘柄数 < 比率 > | 5 銘柄      | 6 銘柄      |              | <0.1%>    |                |
| ユーロ (オランダ)                  |            | 百株        | 百株        | 千ユーロ         | 千円        |                |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV    |            | 291.69    | 383.6     | 927          | 149,869   | コミュニケーション・サービス |
| EXOR NV                     |            | 45        | 50.95     | 450          | 72,743    | 金融             |
| FERROVIAL                   |            | —         | 246.4     | 777          | 125,516   | 資本財・サービス       |
| QIAGEN N. V.                |            | 91.05     | 106.9     | 402          | 64,969    | ヘルスケア          |

| 銘柄                           |         | 期首       | 当        | 期末     |           | 業種等            |
|------------------------------|---------|----------|----------|--------|-----------|----------------|
|                              |         | 株数       | 株数       | 評価額    |           |                |
|                              |         |          |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                |
|                              |         | 百株       | 百株       | 千ユーロ   | 千円        |                |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       |         | 349      | 435.15   | 819    | 132,325   | ヘルスケア          |
| NN GROUP NV                  |         | 112.92   | 120.86   | 383    | 61,976    | 金融             |
| HEINEKEN NV                  |         | 104.07   | 136.49   | 1,129  | 182,352   | 生活必需品          |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N |         | 419.83   | 460.15   | 1,212  | 195,755   | 生活必需品          |
| AKZO NOBEL N. V.             |         | 71       | 78.41    | 550    | 88,875    | 素材             |
| KONINKLIJKE DSM NV           |         | 70.17    | —        | —      | —         | 素材             |
| WOLTERS KLUWER               |         | 105.4    | 120.73   | 1,520  | 245,591   | 資本財・サービス       |
| ING GROEP NV                 |         | 1,568.62 | 1,695.86 | 2,165  | 349,713   | 金融             |
| KONINKLIJKE KPN NV           |         | 1,327.81 | 1,516.71 | 480    | 77,653    | コミュニケーション・サービス |
| ASML HOLDING NV              |         | 163.2    | 188.99   | 11,891 | 1,920,555 | 情報技術           |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         |         | 167      | 189.75   | 237    | 38,384    | 金融             |
| IMCD NV                      |         | 22.46    | 26.78    | 367    | 59,428    | 資本財・サービス       |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES  |         | —        | 40.08    | 515    | 83,214    | 情報技術           |
| ASR NEDERLAND NV             |         | —        | 83.11    | 310    | 50,229    | 金融             |
| ADYEN NV                     |         | 8.7      | 10.18    | 1,107  | 178,853   | 金融             |
| JUST EAT TAKEAWAY            |         | 72.2     | —        | —      | —         | 一般消費財・サービス     |
| PROSUS NV                    |         | 354.8    | 785.72   | 2,363  | 381,656   | 一般消費財・サービス     |
| JDE PEET'S NV                |         | 37       | 57.85    | 141    | 22,816    | 生活必需品          |
| ASM INTERNATIONAL NV         |         | 18.83    | 22.01    | 1,033  | 166,863   | 情報技術           |
| RANDSTAD NV                  |         | 47.2     | 52.75    | 289    | 46,755    | 資本財・サービス       |
| HEINEKEN HOLDING NV          |         | 42.5     | 61.43    | 433    | 69,996    | 生活必需品          |
| OCI NV                       |         | 43.86    | 49.87    | 104    | 16,874    | 素材             |
| EURONEXT NV                  |         | 33       | 38.76    | 294    | 47,639    | 金融             |
| STMICROELECTRONICS NV        |         | 274.39   | 320.41   | 1,378  | 222,703   | 情報技術           |
| AIRBUS SE                    |         | 237.36   | 277.9    | 3,767  | 608,442   | 資本財・サービス       |
| ARGENX SE                    |         | 22.29    | 26.24    | 1,055  | 170,453   | ヘルスケア          |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     |         | 210.64   | 246.06   | 244    | 39,486    | 生活必需品          |
| CNH INDUSTRIAL NV            |         | 402.65   | 479.63   | 464    | 75,063    | 資本財・サービス       |
| STELLANTIS NV                |         | 883.5    | 1,035.31 | 2,041  | 329,643   | 一般消費財・サービス     |
| FERRARI NV                   |         | 50.61    | 59.09    | 1,981  | 320,093   | 一般消費財・サービス     |
| 国小計                          | 株数、金額   | 7,648.75 | 9,404.13 | 40,842 | 6,596,499 |                |
|                              | 銘柄数＜比率＞ | 31銘柄     | 32銘柄     |        | <1.6%>    |                |
| ユーロ（ベルギー）                    |         | 百株       | 百株       | 千ユーロ   | 千円        |                |
| LOTUS BAKERIES NV            |         | —        | 0.21     | 167    | 27,065    | 生活必需品          |
| UCB SA                       |         | 49.76    | 59.4     | 399    | 64,565    | ヘルスケア          |
| KBC GROUP NV                 |         | 98.43    | 117.34   | 615    | 99,457    | 金融             |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  |         | 42       | 43.83    | 316    | 51,181    | 金融             |
| SOLVAY SA                    |         | 29.84    | 34.89    | 367    | 59,421    | 素材             |
| UMICORE                      |         | 82.69    | 98.4     | 240    | 38,825    | 素材             |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   |         | 348.72   | 407.2    | 2,328  | 376,054   | 生活必需品          |
| AGEAS                        |         | 62.9     | 74.99    | 295    | 47,731    | 金融             |
| DIETEREN GROUP               |         | 10.36    | 10.36    | 162    | 26,269    | 一般消費財・サービス     |
| PROXIMUS                     |         | 60.35    | —        | —      | —         | コミュニケーション・サービス |
| ELIA GROUP SA/NV             |         | 13.33    | 14.62    | 144    | 23,258    | 公益事業           |
| SOFINA                       |         | 6        | 6.7      | 135    | 21,923    | 金融             |
| 国小計                          | 株数、金額   | 804.38   | 867.94   | 5,174  | 835,757   |                |
|                              | 銘柄数＜比率＞ | 11銘柄     | 11銘柄     |        | <0.2%>    |                |
| ユーロ（ルクセンブルグ）                 |         | 百株       | 百株       | 千ユーロ   | 千円        |                |
| AROUNDTOWN SA                |         | 380      | —        | —      | —         | 不動産            |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           |         | 期首     | 当        | 期末    |           | 業種等            |
|------------------------------|---------|--------|----------|-------|-----------|----------------|
|                              |         | 株数     | 株数       | 評価額   |           |                |
|                              |         |        |          | 外貨建金額 | 邦貨換算金額    |                |
|                              |         | 百株     | 百株       | 千ユーロ  | 千円        |                |
| ARCELORMITTAL                |         | 257    | 257      | 586   | 94,762    | 素材             |
| EUROFINS SCIENTIFIC          |         | 52.96  | 63.42    | 334   | 54,103    | ヘルスケア          |
| TENARIS SA                   |         | 186.08 | 221.87   | 340   | 54,951    | エネルギー          |
| 国小計                          | 株数、金額   | 876.04 | 542.29   | 1,261 | 203,818   |                |
|                              | 銘柄数<比率> | 4銘柄    | 3銘柄      |       | <0.0%>    |                |
|                              |         | 百株     | 百株       | 千ユーロ  | 千円        |                |
| ユーロ(フランス)                    |         |        |          |       |           |                |
| TOTALENERGIES SE             |         | 995.42 | 1,094.87 | 6,753 | 1,090,702 | エネルギー          |
| MICHELIN (CGDE)              |         | 267.4  | 318.04   | 980   | 158,414   | 一般消費財・サービス     |
| AIR LIQUIDE SA               |         | 209.95 | 245.54   | 4,266 | 689,082   | 素材             |
| KERING                       |         | 30.04  | 34.9     | 1,364 | 220,394   | 一般消費財・サービス     |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        |         | 217.87 | 255.2    | 4,266 | 689,154   | 資本財・サービス       |
| BOUYGUES SA                  |         | 90.62  | 95.72    | 336   | 54,325    | 資本財・サービス       |
| BNP PARIBAS                  |         | 446.02 | 500.23   | 2,847 | 459,868   | 金融             |
| THALES SA                    |         | 42.91  | 49.27    | 683   | 110,332   | 資本財・サービス       |
| DANONE                       |         | 257.08 | 301.95   | 1,786 | 288,462   | 生活必需品          |
| CARREFOUR SA                 |         | 244.54 | 280.25   | 486   | 78,554    | 生活必需品          |
| VIVENDI                      |         | 295.91 | 311.66   | 272   | 44,064    | コミュニケーション・サービス |
| L'OREAL                      |         | 96.88  | 113.09   | 4,883 | 788,781   | 生活必需品          |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    |         | 199.87 | 220.86   | 1,312 | 211,957   | 資本財・サービス       |
| LEGRAND SA                   |         | 107.37 | 125.08   | 1,102 | 178,097   | 資本財・サービス       |
| PERNOD RICARD SA             |         | 84.11  | 95.78    | 1,491 | 240,936   | 生活必需品          |
| EURAZEO SE                   |         | 17.24  | 19.81    | 124   | 20,076    | 金融             |
| SOCIETE GENERALE SA          |         | 319.64 | 355.28   | 807   | 130,485   | 金融             |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI |         | 111.46 | 129.45   | 8,938 | 1,443,660 | 一般消費財・サービス     |
| ACCOR SA                     |         | 67.17  | 83.55    | 264   | 42,682    | 一般消費財・サービス     |
| CAPGEMINI SE                 |         | 65.74  | 77.3     | 1,457 | 235,399   | 情報技術           |
| VALEO SA                     |         | 84     | 91.48    | 123   | 19,997    | 一般消費財・サービス     |
| PUBLICIS GROUPE              |         | 91.79  | 107.3    | 829   | 133,926   | コミュニケーション・サービス |
| BUREAU VERITAS SA            |         | 116.05 | 138.62   | 311   | 50,306    | 資本財・サービス       |
| EIFFAGE                      |         | 32.85  | 36.75    | 340   | 55,057    | 資本財・サービス       |
| SODEXO SA                    |         | 34.91  | 41.57    | 412   | 66,696    | 一般消費財・サービス     |
| IPSEN                        |         | 14     | 17.06    | 175   | 28,352    | ヘルスケア          |
| AMUNDI SA                    |         | 22.5   | 28.88    | 162   | 26,167    | 金融             |
| TELEPERFORMANCE              |         | 23.15  | 27.71    | 361   | 58,315    | 資本財・サービス       |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        |         | 36     | —        | —     | —         | コミュニケーション・サービス |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     |         | 11     | 13.02    | 270   | 43,634    | ヘルスケア          |
| SEB SA                       |         | 9.97   | 11.82    | 123   | 19,968    | 一般消費財・サービス     |
| ESSILORLUXOTTICA             |         | 115.49 | 138.42   | 2,453 | 396,241   | ヘルスケア          |
| DASSAULT AVIATION SA         |         | 10     | 11.08    | 204   | 33,106    | 資本財・サービス       |
| WORLDLINE SA                 |         | 96.06  | 112.65   | 157   | 25,380    | 金融             |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   |         | 41.63  | 49.44    | 163   | 26,446    | 一般消費財・サービス     |
| AXA SA                       |         | 762.06 | 860.16   | 2,446 | 395,101   | 金融             |
| EDENRED                      |         | 100.44 | 116.99   | 585   | 94,513    | 金融             |
| RENAULT SA                   |         | 77.55  | 90.48    | 324   | 52,352    | 一般消費財・サービス     |
| HERMES INTERNATIONAL         |         | 12.72  | 14.85    | 2,817 | 454,980   | 一般消費財・サービス     |
| REMY COINTREAU               |         | 9      | 10.09    | 109   | 17,689    | 生活必需品          |
| DASSAULT SYSTEMES SE         |         | 267.58 | 314.2    | 1,354 | 218,844   | 情報技術           |
| WENDEL                       |         | 9.3    | 11.24    | 88    | 14,250    | 金融             |
| ORANGE                       |         | 800.96 | 877.88   | 988   | 159,623   | コミュニケーション・サービス |
| ALSTOM                       |         | 125.25 | 141.07   | 162   | 26,190    | 資本財・サービス       |
| SANOFI                       |         | 457.21 | 532.73   | 4,521 | 730,231   | ヘルスケア          |

| 銘柄                                 |  | 期首      | 当         | 期末        |           | 業種等            |
|------------------------------------|--|---------|-----------|-----------|-----------|----------------|
|                                    |  | 株数      | 株数        | 評価額       |           |                |
|                                    |  |         |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |                |
|                                    |  | 百株      | 百株        | 千ユーロ      | 千円        |                |
| VINCI SA                           |  | 214.23  | 249.19    | 2,793     | 451,245   | 資本財・サービス       |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT               |  | 261.79  | 318.58    | 913       | 147,569   | 公益事業           |
| CREDIT AGRICOLE SA                 |  | 491.28  | 567.33    | 669       | 108,122   | 金融             |
| BIOMERIEUX                         |  | 16.91   | 18.52     | 183       | 29,564    | ヘルスケア          |
| ENGIE                              |  | 733.28  | 856.25    | 1,359     | 219,498   | 公益事業           |
| EDF                                |  | 221.2   | —         | —         | —         | 公益事業           |
| SAFRAN SA                          |  | 137.22  | 160.24    | 2,566     | 414,448   | 資本財・サービス       |
| ARKEMA                             |  | 23.95   | 28.29     | 264       | 42,730    | 素材             |
| ADP                                |  | 11.1    | 13.43     | 151       | 24,510    | 資本財・サービス       |
| GETLINK SE                         |  | 173.45  | 194.11    | 325       | 52,496    | 資本財・サービス       |
| BOLLORE                            |  | 356.75  | 391.41    | 209       | 33,757    | コミュニケーション・サービス |
| 国小計                                |  | 株数、金額   | 10,169.87 | 11,300.67 | 73,349    | 11,846,755     |
|                                    |  | 銘柄数＜比率＞ | 56銘柄      | 54銘柄      |           | <2.8%>         |
|                                    |  | 百株      | 百株        | 千ユーロ      | 千円        |                |
| ユーロ（ドイツ）                           |  |         |           |           |           |                |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG           |  | 179.02  | 231.24    | 689       | 111,407   | 資本財・サービス       |
| DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED) |  | 46      | 53.38     | 453       | 73,178    | 一般消費財・サービス     |
| BAYER AG-REG                       |  | 394.42  | 460.56    | 1,412     | 228,138   | ヘルスケア          |
| EVONIK INDUSTRIES AG               |  | 80      | 94.86     | 165       | 26,673    | 素材             |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED        |  | 813.28  | 909.46    | 1,025     | 165,570   | 金融             |
| COMMERZBANK AG                     |  | 420.31  | 498.95    | 564       | 91,101    | 金融             |
| VOLKSWAGEN AG                      |  | 12      | 13.04     | 155       | 25,157    | 一般消費財・サービス     |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                 |  | 74.51   | 96.57     | 1,032     | 166,700   | 一般消費財・サービス     |
| SIEMENS AG-REG                     |  | 307.42  | 356.31    | 5,447     | 879,788   | 資本財・サービス       |
| E.ON SE                            |  | 901.36  | 1,052.52  | 1,260     | 203,566   | 公益事業           |
| UNIPER SE                          |  | 66.5    | —         | —         | —         | 公益事業           |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG        |  | 132.93  | 149.09    | 1,432     | 231,332   | 一般消費財・サービス     |
| GEA GROUP AG                       |  | 58      | 72.18     | 243       | 39,286    | 資本財・サービス       |
| CONTINENTAL AG                     |  | 43.42   | 51.68     | 370       | 59,763    | 一般消費財・サービス     |
| BASF SE                            |  | 368.75  | 418.85    | 1,800     | 290,719   | 素材             |
| ALLIANZ SE-REG                     |  | 164.11  | 189.07    | 4,367     | 705,397   | 金融             |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG         |  | 71.68   | 79.26     | 565       | 91,375    | 生活必需品          |
| RHEINMETALL AG                     |  | 18.13   | 20.42     | 561       | 90,761    | 資本財・サービス       |
| RWE AG                             |  | 257.91  | 296.64    | 1,164     | 188,095   | 公益事業           |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG             |  | 219.5   | 270.29    | 216       | 35,010    | 資本財・サービス       |
| BRENNTAG SE                        |  | 60.9    | 69.69     | 538       | 86,961    | 資本財・サービス       |
| FRESENIUS SE & CO KGAA             |  | 164.83  | 198       | 565       | 91,363    | ヘルスケア          |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE       |  | 38.39   | —         | —         | —         | コミュニケーション・サービス |
| SAP SE                             |  | 419.6   | 489.54    | 7,075     | 1,142,814 | 情報技術           |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG         |  | 56.25   | 63.79     | 2,471     | 399,230   | 金融             |
| ZALANDO SE                         |  | 87.83   | 105.53    | 233       | 37,633    | 一般消費財・サービス     |
| HEIDELBERG MATERIALS AG            |  | 57.08   | 68.04     | 504       | 81,429    | 素材             |
| KION GROUP AG                      |  | 27      | —         | —         | —         | 資本財・サービス       |
| COVESTRO AG                        |  | 73      | 90.78     | 441       | 71,256    | 素材             |
| RATIONAL AG                        |  | 1.9     | 2.42      | 142       | 23,060    | 資本財・サービス       |
| SARTORIUS AG-VORZUG                |  | 12.1    | 12.1      | 356       | 57,553    | ヘルスケア          |
| TALANX AG                          |  | —       | 31.19     | 204       | 33,096    | 金融             |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF         |  | 60.35   | 71.94     | 325       | 52,529    | 一般消費財・サービス     |
| DELIVERY HERO SE                   |  | 64.43   | 82.46     | 250       | 40,520    | 一般消費財・サービス     |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR         |  | 15.92   | 18.94     | 159       | 25,689    | ヘルスケア          |
| BECHTLE AG                         |  | 32.38   | 36.26     | 165       | 26,804    | 情報技術           |
| NEMETSCHEK SE                      |  | 22.84   | 25.57     | 207       | 33,467    | 情報技術           |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                 |         | 期首        | 当         | 期末     |           | 業種等            |
|------------------------------------|---------|-----------|-----------|--------|-----------|----------------|
|                                    |         | 株数        | 株数        | 評価額    |           |                |
|                                    |         |           |           | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                |
|                                    |         | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円        |                |
| SCOUT24 AG                         |         | 36        | 36        | 227    | 36,816    | コミュニケーション・サービス |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG            |         | 110.97    | 132.18    | 692    | 111,908   | ヘルスケア          |
| KNORR-BREMSE AG                    |         | 28        | 34.13     | 197    | 31,894    | 資本財・サービス       |
| HELLOFRESH SE                      |         | 65.16     | 71.77     | 103    | 16,715    | 生活必需品          |
| SIEMENS ENERGY AG                  |         | 172.9     | 237.42    | 255    | 41,279    | 資本財・サービス       |
| BEIERSDORF AG                      |         | 39.8      | 47.25     | 610    | 98,558    | 生活必需品          |
| MERCK KGAA                         |         | 51.89     | 60.59     | 971    | 156,965   | ヘルスケア          |
| ADIDAS AG                          |         | 72        | 75.75     | 1,459  | 235,781   | 一般消費財・サービス     |
| PUMA SE                            |         | 41.63     | 49.69     | 290    | 46,932    | 一般消費財・サービス     |
| HENKEL AG & CO KGAA                |         | 41.01     | 48.83     | 306    | 49,448    | 生活必需品          |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG            |         | 1,301.22  | 1,519.48  | 3,332  | 538,309   | コミュニケーション・サービス |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &        |         | 80.7      | 96.5      | 359    | 58,103    | ヘルスケア          |
| MERCEDES-BENZ GROUP N AG           |         | 325       | 387.64    | 2,298  | 371,201   | 一般消費財・サービス     |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG           |         | 524.3     | 612.22    | 2,185  | 353,000   | 情報技術           |
| HANNOVER RUECK SE                  |         | 23.78     | 28.26     | 614    | 99,272    | 金融             |
| DHL GROUP                          |         | 397.96    | 463.85    | 1,990  | 321,466   | 資本財・サービス       |
| DEUTSCHE BOERSE AG                 |         | 76.28     | 89.07     | 1,550  | 250,383   | 金融             |
| MTU AERO ENGINES AG                |         | 21.04     | 25.24     | 474    | 76,577    | 資本財・サービス       |
| WACKER CHEMIE AG                   |         | —         | 8.99      | 101    | 16,392    | 素材             |
| SYMRISE AG                         |         | 52.28     | 62.24     | 631    | 101,931   | 素材             |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI       |         | 413.12    | 413.12    | 97     | 15,679    | コミュニケーション・サービス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF       |         | 22        | 26.86     | 234    | 37,850    | 一般消費財・サービス     |
| VONOVIA SE                         |         | 287.7     | 345.42    | 896    | 144,771   | 不動産            |
| LEG IMMOBILIEN SE                  |         | 28        | 35.01     | 251    | 40,655    | 不動産            |
| 国小計                                | 株数、金額   | 10,036.79 | 11,588.13 | 56,704 | 9,158,335 |                |
|                                    | 銘柄数<比率> | 59銘柄      | 58銘柄      |        | <2.2%>    |                |
| ユーロ（ポルトガル）                         |         | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円        |                |
| JERONIMO MARTINS                   |         | 114.16    | 133.3     | 300    | 48,483    | 生活必需品          |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA        |         | 1,094     | 1,480.83  | 652    | 105,329   | 公益事業           |
| GALP ENERGIA SGPS SA               |         | 201.96    | 231.18    | 314    | 50,854    | エネルギー          |
| 国小計                                | 株数、金額   | 1,410.12  | 1,845.31  | 1,267  | 204,668   |                |
|                                    | 銘柄数<比率> | 3銘柄       | 3銘柄       |        | <0.0%>    |                |
| ユーロ（スペイン）                          |         | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円        |                |
| CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV |         | —         | 29.38     | 78     | 12,688    | 公益事業           |
| TELEFONICA SA                      |         | 2,104.78  | 2,425.11  | 942    | 152,284   | コミュニケーション・サービス |
| ENDESA SA                          |         | 121       | 143.67    | 274    | 44,319    | 公益事業           |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA       |         | 2,677     | 2,793.58  | 2,429  | 392,355   | 金融             |
| IBERDROLA SA                       |         | 2,395.38  | 2,858.48  | 3,231  | 521,921   | 公益事業           |
| REPSOL SA                          |         | 572.01    | 606       | 849    | 137,269   | エネルギー          |
| GRIFOLS SA                         |         | 118.3     | 140.39    | 177    | 28,705    | ヘルスケア          |
| BANCO SANTANDER SA                 |         | 6,823.35  | 7,575.56  | 2,877  | 464,696   | 金融             |
| AMADEUS IT GROUP SA                |         | 180.86    | 211.19    | 1,347  | 217,685   | 一般消費財・サービス     |
| NATURGY ENERGY GROUP SA            |         | 103       | 103       | 280    | 45,248    | 公益事業           |
| CAIXABANK SA                       |         | 1,749.27  | 1,950.84  | 818    | 132,239   | 金融             |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV        |         | 88.76     | 103.06    | 378    | 61,187    | 資本財・サービス       |
| AENA SME SA                        |         | 29        | 35.15     | 550    | 88,846    | 資本財・サービス       |
| CELLNEX TELECOM SA                 |         | 214.6     | 264.97    | 930    | 150,211   | コミュニケーション・サービス |
| ACCIONA SA                         |         | 10.28     | 11.17     | 143    | 23,236    | 公益事業           |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL         |         | 437.94    | 511.38    | 1,919  | 310,054   | 一般消費財・サービス     |

| 銘 柄                          |               | 期 首       | 当         | 期 末    |           | 業 種 等          |
|------------------------------|---------------|-----------|-----------|--------|-----------|----------------|
|                              |               | 株 数       | 株 数       | 評 価 額  |           |                |
|                              |               |           |           | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                |
|                              |               | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円        |                |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE |               | 94.14     | —         | —      | —         | 資本財・サービス       |
| ENAGAS SA                    |               | 98.84     | 117.14    | 196    | 31,680    | 公益事業           |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA |               | 157       | 190.67    | 292    | 47,208    | 公益事業           |
| FERROVIAL SA                 |               | 190.18    | —         | —      | —         | 資本財・サービス       |
| EDP RENOVAVEIS SA            |               | 115.94    | 145.54    | 237    | 38,420    | 公益事業           |
| 国 小 計                        | 株 数、金 額       | 18,281.63 | 20,216.28 | 17,957 | 2,900,261 |                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 20 銘柄     | 19 銘柄     |        | <0.7%>    |                |
| ユーロ (イタリア)                   |               | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円        |                |
| PRYSMIAN SPA                 |               | 100.4     | 123.78    | 436    | 70,510    | 資本財・サービス       |
| ASSICURAZIONI GENERALI       |               | 446       | 488.78    | 927    | 149,754   | 金融             |
| MEDIOBANCA SPA               |               | 244.07    | 262.3     | 281    | 45,456    | 金融             |
| UNICREDIT SPA                |               | 832.17    | 862.65    | 2,184  | 352,844   | 金融             |
| TELECOM ITALIA SPA           |               | 3,787.82  | 4,343.74  | 114    | 18,479    | コミュニケーション・サービス |
| INTESA SANPAOLO              |               | 6,630.75  | 7,214.38  | 1,909  | 308,368   | 金融             |
| ATLANTIA SPA                 |               | 195.31    | —         | —      | —         | 資本財・サービス       |
| POSTE ITALIANE SPA           |               | 210.74    | 245.93    | 241    | 38,981    | 金融             |
| MONCLER SPA                  |               | 82.61     | 96.54     | 492    | 79,551    | 一般消費財・サービス     |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  |               | 42.17     | 49.12     | 217    | 35,160    | ヘルスケア          |
| ENI SPA                      |               | 1,013.29  | 1,100.08  | 1,662  | 268,429   | エネルギー          |
| DIASORIN SPA                 |               | 10        | 11.44     | 98     | 15,919    | ヘルスケア          |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL |               | 128       | 158.1     | 178    | 28,854    | コミュニケーション・サービス |
| NEXI SPA                     |               | 199       | 278.66    | 197    | 31,963    | 金融             |
| AMPLIFON SPA                 |               | 47        | 56.32     | 159    | 25,687    | ヘルスケア          |
| ENEL SPA                     |               | 3,265.35  | 3,812.94  | 2,452  | 396,162   | 公益事業           |
| SNAM SPA                     |               | 793.5     | 947.44    | 431    | 69,762    | 公益事業           |
| TERNA SPA                    |               | 554.64    | 659.48    | 488    | 78,904    | 公益事業           |
| FINECOBANK SPA               |               | 232       | 286.93    | 351    | 56,699    | 金融             |
| 国 小 計                        | 株 数、金 額       | 18,814.82 | 20,998.61 | 12,825 | 2,071,491 |                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 19 銘柄     | 18 銘柄     |        | <0.5%>    |                |
| ユーロ (フィンランド)                 |               | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円        |                |
| UPM-KYMMENE OYJ              |               | 214.28    | 250.22    | 800    | 129,321   | 素材             |
| NOKIA OYJ                    |               | 2,172.54  | 2,511.61  | 815    | 131,714   | 情報技術           |
| WARTSILA OYJ ABP             |               | 191.24    | 222.36    | 282    | 45,609    | 資本財・サービス       |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |               | 214       | 263.2     | 315    | 50,947    | 素材             |
| ELISA OYJ                    |               | 57.25     | 64.14     | 264    | 42,721    | コミュニケーション・サービス |
| SAMPO OYJ-A SHS              |               | 196.22    | 215.14    | 845    | 136,608   | 金融             |
| FORTUM OYJ                   |               | 169       | 210.78    | 273    | 44,119    | 公益事業           |
| KESKO OYJ-B SHS              |               | 104       | 123.55    | 216    | 34,890    | 生活必需品          |
| KONE OYJ-B                   |               | 133.75    | 159.31    | 649    | 104,876   | 資本財・サービス       |
| NESTE OYJ                    |               | 169.85    | 198.34    | 678    | 109,555   | エネルギー          |
| ORION OYJ-CLASS B            |               | 40        | 48.46     | 176    | 28,567    | ヘルスケア          |
| METSO CORPORATION            |               | —         | 313.51    | 285    | 46,087    | 資本財・サービス       |
| 国 小 計                        | 株 数、金 額       | 3,662.13  | 4,580.62  | 5,603  | 905,022   |                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 11 銘柄     | 12 銘柄     |        | <0.2%>    |                |
| ユーロ (オーストリア)                 |               | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円        |                |
| VERBUND AG                   |               | 27.4      | 32.05     | 271    | 43,844    | 公益事業           |
| OMV AG                       |               | 56.5      | 69.2      | 272    | 44,001    | エネルギー          |
| ERSTE GROUP BANK AG          |               | 135.46    | 161.16    | 591    | 95,604    | 金融             |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘                                         |   | 柄 | 期       | 首      | 当          |            | 期       |     | 末           | 業       | 種  | 等 |   |
|-------------------------------------------|---|---|---------|--------|------------|------------|---------|-----|-------------|---------|----|---|---|
|                                           |   |   | 株       | 数      | 株          | 数          | 評       |     | 価           |         |    |   | 額 |
|                                           |   |   |         |        |            |            | 外貨建金額   |     | 邦貨換算金額      |         |    |   |   |
| VOESTALPINE AG                            |   |   | 百株      | 42.5   | 百株         | 54.8       | 千ユーロ    | 142 | 千円          | 23,047  | 素材 |   |   |
| 国                                         | 小 | 計 | 株数、金額   |        | 261.86     | 317.21     | 1,278   |     | 206,497     |         |    |   |   |
|                                           |   |   | 銘柄数<比率> |        | 4銘柄        | 4銘柄        |         |     | <0.0%>      |         |    |   |   |
| ユーロ（その他）<br>DSM FIRMENICH AG<br>AEGON LTD |   |   | 百株      | —      | 百株         | 87.74      | 千ユーロ    | 764 | 千円          | 123,527 | 素材 |   |   |
|                                           |   |   |         | 720.59 |            | 774.29     |         | 382 |             | 61,802  | 金融 |   |   |
| 国                                         | 小 | 計 | 株数、金額   |        | 720.59     | 862.03     | 1,147   |     | 185,330     |         |    |   |   |
|                                           |   |   | 銘柄数<比率> |        | 1銘柄        | 2銘柄        |         |     | <0.0%>      |         |    |   |   |
| ユ                                         | ー | 口 | 株数、金額   |        | 73,283.3   | 84,049.52  | 220,781 |     | 35,658,394  |         |    |   |   |
|                                           |   |   | 銘柄数<比率> |        | 224銘柄      | 222銘柄      |         |     | <8.6%>      |         |    |   |   |
| フ                                         | ァ | ン | 株数、金額   |        | 452,459.55 | 543,575.93 | —       |     | 373,664,357 |         |    |   |   |
|                                           |   |   | 銘柄数<比率> |        | 1,209銘柄    | 1,213銘柄    |         |     | <89.9%>     |         |    |   |   |

（注1）邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
（注2）＜ ＞内は純資産総額に対する評価額の比率。  
（注3）評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資証券

| 銘                                 |  | 期首<br>口数 | 当<br>口数 | 期末<br>評価額 |         |
|-----------------------------------|--|----------|---------|-----------|---------|
|                                   |  |          |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |
|                                   |  |          |         |           |         |
| (アメリカ)                            |  | 千口       | 千口      | 千アメリカ・ドル  | 千円      |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC         |  | 5.837    | 6.937   | 1,185     | 174,284 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC          |  | 13.607   | 15.807  | 1,940     | 285,384 |
| BOSTON PROPERTIES INC             |  | 6.2      | 7.2     | 410       | 60,357  |
| VORNADO REALTY TRUST              |  | 6.297    | —       | —         | —       |
| SBA COMMUNICATIONS CORP           |  | 4.5      | 5.2     | 1,275     | 187,520 |
| EQUITY RESIDENTIAL                |  | 14.8     | 17.4    | 984       | 144,789 |
| EQUINIX INC                       |  | 3.808    | 4.508   | 3,643     | 535,902 |
| AMERICAN TOWER CORP               |  | 18.9     | 22.5    | 4,639     | 682,265 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC         |  | 29.043   | 34.443  | 600       | 88,342  |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A          |  | 13       | 15.7    | 561       | 82,639  |
| KIMCO REALTY CORP                 |  | 25       | 30      | 570       | 83,918  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS |  | 15.5     | 18.5    | 279       | 41,165  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE      |  | 11       | 12.7    | 582       | 85,694  |
| INVITATION HOMES INC              |  | 25.2     | 29.6    | 975       | 143,483 |
| VICI PROPERTIES INC               |  | 39.8     | 48.6    | 1,439     | 211,711 |
| VENTAS INC                        |  | 16.5     | 19.4    | 880       | 129,561 |
| WEYERHAEUSER CO                   |  | 30.814   | 35.414  | 1,122     | 165,104 |
| CROWN CASTLE INTL CORP            |  | 17.9     | 21      | 2,435     | 358,200 |
| IRON MOUNTAIN INC                 |  | 11.8     | 14.1    | 892       | 131,222 |
| SUN COMMUNITIES INC               |  | 5        | 6       | 768       | 112,949 |
| PROLOGIS INC                      |  | 38.154   | 44.654  | 5,047     | 742,363 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT      |  | 6.4      | 7.9     | 861       | 126,653 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST             |  | 4.2      | 5.2     | 466       | 68,637  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC          |  | 2.7      | 3.1     | 657       | 96,759  |
| WELLTOWER INC                     |  | 18.8     | 24      | 2,116     | 311,317 |

| 銘柄                                 |         | 期首      | 当         | 期末          |           |
|------------------------------------|---------|---------|-----------|-------------|-----------|
|                                    |         | 口数      | 口数        | 評価額         |           |
|                                    |         |         |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |
|                                    |         | 千口      | 千口        | 千アメリカ・ドル    | 千円        |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC          |         | 21.9    | 26.5      | 454         | 66,800    |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM         |         | 4.8     | 5.6       | 693         | 102,010   |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES        |         | 7.2     | 8.6       | 602         | 88,649    |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN       |         | 17.9    | 23.9      | 432         | 63,621    |
| REALTY INCOME CORP                 |         | 24.895  | 32.595    | 1,749       | 257,280   |
| PUBLIC STORAGE                     |         | 6.5     | 7.7       | 1,985       | 292,056   |
| REGENCY CENTERS CORP               |         | 6.3     | 8.1       | 497         | 73,227    |
| UDR INC                            |         | 12.9    | 15.1      | 502         | 73,929    |
| WP CAREY INC                       |         | 8       | 10.3      | 640         | 94,206    |
| DIGITAL REALTY TRUST INC           |         | 11.8    | 14.1      | 1,948       | 286,583   |
| EXTRA SPACE STORAGE INC            |         | 5.6     | 10.5      | 1,360       | 200,024   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC       |         | 24.2    | —         | —           | —         |
| アメリカ・ドル通貨計                         | 口数、金額   | 536.755 | 612.858   | 45,207      | 6,648,620 |
|                                    | 銘柄数<比率> | 37銘柄    | 35銘柄      |             | <1.6%>    |
| (カナダ)                              |         | 千口      | 千口        | 千カナダ・ドル     | 千円        |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA       |         | 3.4     | 3.8       | 174         | 18,841    |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR        |         | 5.8     | 6.9       | 120         | 13,014    |
| カナダ・ドル通貨計                          | 口数、金額   | 9.2     | 10.7      | 294         | 31,855    |
|                                    | 銘柄数<比率> | 2銘柄     | 2銘柄       |             | <0.0%>    |
| (オーストラリア)                          |         | 千口      | 千口        | 千オーストラリア・ドル | 千円        |
| DEXUS/AU                           |         | 40.978  | 48.731    | 341         | 33,241    |
| LENDLEASE GROUP                    |         | 25.3    | 31.401    | 209         | 20,410    |
| TRANSURBAN GROUP                   |         | 119.689 | 138.948   | 1,782       | 173,724   |
| APA GROUP                          |         | 45.041  | 53.35     | 449         | 43,775    |
| SCENTRE GROUP                      |         | 203.007 | 235.284   | 618         | 60,301    |
| GPT GROUP                          |         | 73.031  | 86.791    | 354         | 34,507    |
| MIRVAC GROUP                       |         | 144.9   | 173.08    | 340         | 33,227    |
| STOCKLAND                          |         | 91.123  | 104.777   | 426         | 41,556    |
| GOODMAN GROUP                      |         | 65.537  | 76.496    | 1,783       | 173,839   |
| VICINITY CENTRES                   |         | 151.865 | 175.417   | 318         | 31,026    |
| オーストラリア・ドル通貨計                      | 口数、金額   | 960.471 | 1,124.275 | 6,625       | 645,611   |
|                                    | 銘柄数<比率> | 10銘柄    | 10銘柄      |             | <0.2%>    |
| (香港)                               |         | 千口      | 千口        | 千香港・ドル      | 千円        |
| LINK REIT                          |         | 90.8    | 131.5     | 5,115       | 96,373    |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS        |         | 107     | —         | —           | —         |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS           |         | 163     | 197       | 1,654       | 31,176    |
| 香港・ドル通貨計                           | 口数、金額   | 360.8   | 328.5     | 6,770       | 127,549   |
|                                    | 銘柄数<比率> | 3銘柄     | 2銘柄       |             | <0.0%>    |
| (シンガポール)                           |         | 千口      | 千口        | 千シンガポール・ドル  | 千円        |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT           |         | 144.5   | 194       | 550         | 60,814    |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER       |         | 220.07  | 276.67    | 511         | 56,496    |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST          |         | 140.8   | 170.2     | 275         | 30,434    |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS |         | 101.3   | 112.7     | 154         | 17,042    |
| シンガポール・ドル通貨計                       | 口数、金額   | 606.67  | 753.57    | 1,492       | 164,788   |
|                                    | 銘柄数<比率> | 4銘柄     | 4銘柄       |             | <0.0%>    |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘                                                                       |  | 柄             | 期 首         | 当           | 期 末         |              |
|-------------------------------------------------------------------------|--|---------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
|                                                                         |  |               | □ 数         | □ 数         | 評 価 額       | 額            |
|                                                                         |  |               | 千□          | 千□          | 千イギリス・ポンド   | 千円           |
| (イギリス)<br>LAND SECURITIES GROUP PLC<br>SEGRO PLC<br>BRITISH LAND CO PLC |  |               | 28.317      | 33.482      | 210         | 39,323       |
|                                                                         |  |               | 48.274      | 55.182      | 452         | 84,584       |
|                                                                         |  |               | 35.395      | —           | —           | —            |
| イギリス・ポンド通貨計                                                             |  | □ 数、金 額       | 111.986     | 88.664      | 663         | 123,908      |
|                                                                         |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3 銘柄        | 2 銘柄        |             | <0.0%>       |
| (ユーロ (ベルギー))<br>WAREHOUSES DE PAUW SCA                                  |  |               | 千□<br>6.192 | 千□<br>7.389 | 千ユーロ<br>188 | 千円<br>30,455 |
|                                                                         |  | □ 数、金 額       | 6.192       | 7.389       | 188         | 30,455       |
|                                                                         |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 銘柄        | 1 銘柄        |             | <0.0%>       |
| 国 小 計                                                                   |  |               | 千□<br>4.6   | 千□<br>5.554 | 千ユーロ<br>318 | 千円<br>51,363 |
|                                                                         |  |               | 1.817       | 2.164       | 218         | 35,370       |
|                                                                         |  |               | 8.527       | 10.126      | 233         | 37,778       |
|                                                                         |  |               | 2           | 2.399       | 106         | 17,187       |
|                                                                         |  | □ 数、金 額       | 16.944      | 20.243      | 877         | 141,700      |
|                                                                         |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4 銘柄        | 4 銘柄        |             | <0.0%>       |
| ユ ー ロ 通 貨 計                                                             |  | □ 数、金 額       | 23.136      | 27.632      | 1,065       | 172,156      |
|                                                                         |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5 銘柄        | 5 銘柄        |             | <0.0%>       |
| 合 計                                                                     |  | □ 数、金 額       | 2,609.018   | 2,946.199   | —           | 7,914,490    |
|                                                                         |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 64 銘柄       | 60 銘柄       |             | <1.9%>       |

(注 1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注 2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

| 銘 柄 別 |                              | 当 期 末         |          |
|-------|------------------------------|---------------|----------|
|       |                              | 買 建 額         | 売 建 額    |
| 外 国   | S&P500 EMINI FUT<br>(アメリカ)   | 百万円<br>24,004 | 百万円<br>— |
|       | S&P/TSX 60 IX FUT<br>(カナダ)   | 1,783         | —        |
|       | SPI 200 FUTURES<br>(オーストラリア) | 1,202         | —        |
|       | FTSE 100 IDX FUT<br>(イギリス)   | 1,738         | —        |
|       | SWISS MKT IX FUTR<br>(ドイツ)   | 1,366         | —        |
|       | EURO STOXX 50<br>(ドイツ)       | 4,102         | —        |
|       |                              |               |          |

(注 1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 株式           | 373,664,357 | 89.7  |
| 投資証券         | 7,914,490   | 1.9   |
| コール・ローン等、その他 | 34,833,809  | 8.4   |
| 投資信託財産総額     | 416,412,657 | 100.0 |

(注 1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注 2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝147.07円、1カナダ・ドル＝108.21円、1オーストラリア・ドル＝97.45円、1香港・ドル＝18.84円、1シンガポール・ドル＝110.38円、1ニュー・ゼーランド・ドル＝90.70円、1イギリス・ポンド＝186.84円、1イスラエル・シェケル＝39.913円、1スイス・フラン＝168.56円、1デンマーク・クローネ＝21.66円、1ノルウェー・クローネ＝13.81円、1スウェーデン・クローネ＝14.21円、1ユーロ＝161.51円です。

(注 3) 当期末における外貨建純資産（394,774,332千円）の投資信託財産総額（416,412,657千円）に対する比率は、94.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

| 項 目            | 当 期 末            |
|----------------|------------------|
| (A)資産          | 437,391,983,390円 |
| コール・ローン等       | 25,889,333,630   |
| 株式（評価額）        | 373,664,357,535  |
| 投資証券（評価額）      | 7,914,490,575    |
| 未収入金           | 21,749,483,507   |
| 未収配当金          | 501,157,490      |
| 差入委託証拠金        | 7,673,160,653    |
| (B)負債          | 21,521,967,015   |
| 未払金            | 21,409,528,115   |
| 未払解約金          | 112,438,900      |
| (C)純資産総額（A－B）  | 415,870,016,375  |
| 元本             | 78,806,686,628   |
| 次期繰越損益金        | 337,063,329,747  |
| (D)受益権総口数      | 78,806,686,628口  |
| 1万口当り基準価額（C／D） | 52,771円          |

\* 期首における元本額は69,133,888,947円、当作成期間中における追加設定元本額は14,051,097,197円、同解約元本額は4,378,299,516円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

|                                              |                 |
|----------------------------------------------|-----------------|
| ダイワ外国株式インデックスVA                              | 253,960,411円    |
| ダイワ国内重視バランスファンド3 0 VA（一般投資家私募）               | 2,398,033円      |
| ダイワ国内重視バランスファンド5 0 VA（一般投資家私募）               | 27,113,381円     |
| ダイワ国際分散バランスファンド3 0 VA（一般投資家私募）               | 4,173,336円      |
| ダイワ国際分散バランスファンド5 0 VA（一般投資家私募）               | 132,412,472円    |
| 外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）             | 99,283,243円     |
| ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）                | 90,561,111円     |
| ダイワファンドラップ外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）      | 751,588,780円    |
| ダイワファンドラップ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）                | 4,575,264,354円  |
| ダイワファンドラップオンライン外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） | 565,403,560円    |
| D－I's 外国株式インデックス                             | 20,741,287円     |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2050                           | 52,732,027円     |
| i Free 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）                   | 7,602,914,266円  |
| i Free 8資産バランス                               | 1,483,695,864円  |
| i Free 年金バランス                                | 320,411,034円    |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2060                           | 3,052,677円      |
| DCダイワ外国株式インデックス                              | 47,516,377,923円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3 0                              | 507,111,516円    |
| ダイワ・ライフ・バランス5 0                              | 1,075,299,438円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7 0                              | 1,029,409,746円  |
| 大和DC海外株式インデックスファンド                           | 2,012,098,874円  |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030                           | 12,430,841円     |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040                           | 12,894,554円     |
| ダイワつみたてインデックス外国株式                            | 2,126,545,615円  |
| ダイワつみたてインデックスバランス3 0                         | 2,059,357円      |
| ダイワつみたてインデックスバランス5 0                         | 2,504,278円      |
| ダイワつみたてインデックスバランス7 0                         | 5,293,680円      |
| ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）              | 11,365,941円     |
| ダイワ世界バランスファンド4 0 VA                          | 54,089,276円     |
| ダイワ世界バランスファンド6 0 VA                          | 34,472,185円     |
| ダイワ・バランスファンド3 5 VA                           | 912,121,494円    |
| ダイワ・バランスファンド2 5 VA（適格機関投資家専用）                | 48,039,078円     |
| ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）                | 140,584,660円    |
| ダイワ・インデックスセレクト 外国株式                          | 1,397,074,322円  |
| ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド                           | 429,662,271円    |
| ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）             | 2,299,488,278円  |
| ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス                           | 3,021,971,653円  |
| ダイワライフスタイル2 5                                | 8,689,227円      |
| ダイワライフスタイル5 0                                | 39,113,782円     |
| ダイワライフスタイル7 5                                | 32,628,804円     |
| ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）                | 89,653,999円     |

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は52,771円です。

■損益の状況

当期 自 2022年12月 1 日 至 2023年11月30日

| 項 目                       | 当 期              |
|---------------------------|------------------|
| (A) 配当等収益                 | 6,771,854,280円   |
| 受取配当金                     | 6,504,570,354    |
| 受取利息                      | 44,080,104       |
| その他収益金                    | 227,504,113      |
| 支払利息                      | △ 4,300,291      |
| (B) 有価証券売買損益              | 62,831,381,001   |
| 売買益                       | 84,924,975,155   |
| 売買損                       | △ 22,093,594,154 |
| (C) 先物取引等損益               | 2,566,038,828    |
| 取引益                       | 3,359,283,660    |
| 取引損                       | △ 793,244,832    |
| (D) その他費用                 | △ 59,415,452     |
| (E) 当期損益金 (A + B + C + D) | 72,109,858,657   |
| (F) 前期繰越損益金               | 229,239,375,441  |
| (G) 解約差損益金                | △ 16,142,416,184 |
| (H) 追加信託差損益金              | 51,856,511,833   |
| (I) 合計 (E + F + G + H)    | 337,063,329,747  |
| 次期繰越損益金 (I)               | 337,063,329,747  |

- (注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

《お知らせ》  
■ベンチマークの変更について  
ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。  
変更前：MSCIコクサイ指数（円ベース）  
変更後：MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）