

D－I's 外国株式 インデックス

運用報告書(全体版)

第 6 期

(決算日 2019年12月 2 日)

(作成対象期間 2018年12月 1 日～2019年12月 2 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（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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
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	約15年間（2013年12月9日～2028年11月30日）		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（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

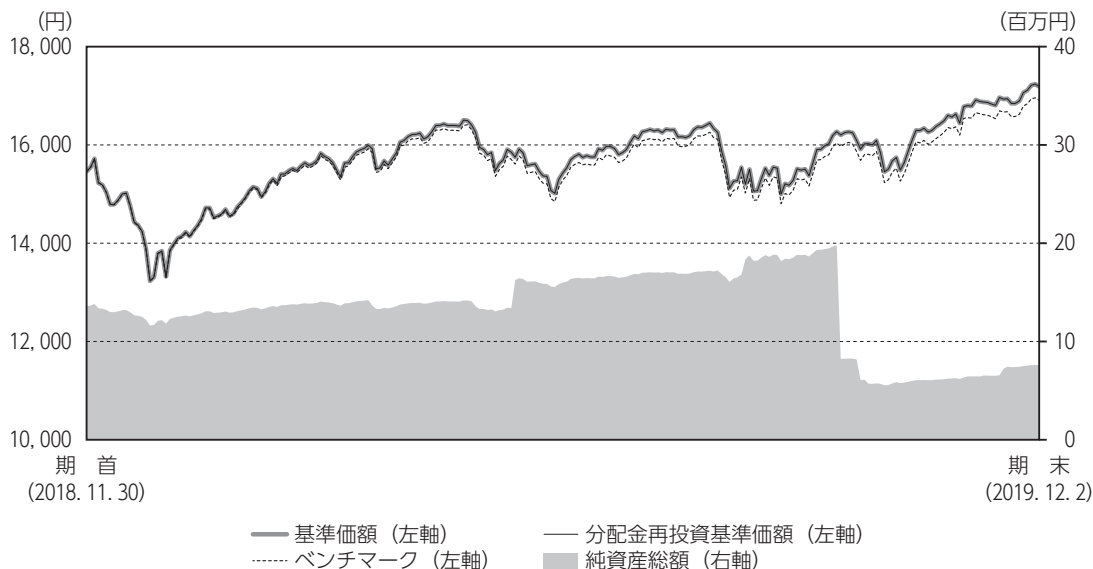
決 算 期	基 準 価 額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2 期末 (2015年11月30日)	13, 215	0	1. 8	12, 813	0. 1	96. 2	1. 3	2. 4	3
3 期末 (2016年11月30日)	12, 451	0	△ 5. 8	11, 850	△ 7. 5	96. 0	1. 4	2. 5	3
4 期末 (2017年11月30日)	15, 170	0	21. 8	14, 224	20. 0	95. 5	1. 8	2. 6	2
5 期末 (2018年11月30日)	15, 460	0	1. 9	14, 271	0. 3	95. 1	2. 3	2. 6	13
6 期末 (2019年12月 2 日)	17, 187	0	11. 2	15, 611	9. 4	90. 5	6. 7	2. 7	7

- (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（円ベース）は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数（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として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数（米ドルベース）は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、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 Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。
- (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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、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（円ベース）です。

基準価額・騰落率

期 首：15,460円

期 末：17,187円（分配金0円）

騰落率：11.2%（分配金込み）

基準価額の変動要因

ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ベース））の動きをほぼ反映して、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。

D－I's 外国株式インデックス

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)2018年11月30日	円	%		%	%	%	%
	15,460	—	14,271	—	95.1	2.3	2.6
12月末	13,842	△ 10.5	12,759	△ 10.6	96.2	1.2	2.7
2019年1月末	14,737	△ 4.7	13,563	△ 5.0	96.1	1.2	2.7
2月末	15,613	1.0	14,371	0.7	96.2	1.1	2.7
3月末	15,713	1.6	14,436	1.2	95.8	1.6	2.8
4月末	16,408	6.1	15,056	5.5	96.4	0.9	2.7
5月末	15,361	△ 0.6	14,038	△ 1.6	96.0	1.1	2.8
6月末	15,907	2.9	14,523	1.8	95.8	1.6	2.8
7月末	16,331	5.6	14,901	4.4	95.7	1.5	2.7
8月末	15,514	0.3	14,135	△ 1.0	95.0	2.0	2.9
9月末	16,001	3.5	14,566	2.1	95.8	1.2	3.0
10月末	16,630	7.6	15,111	5.9	91.0	6.1	2.8
11月末	17,239	11.5	15,657	9.7	90.6	6.6	2.7
(期末)2019年12月2日	17,187	11.2	15,611	9.4	90.5	6.7	2.7

(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

(2018. 12. 1 ~ 2019. 12. 2)

■海外株式市況

米国・欧州を中心とする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、米中関係悪化への懸念が高まったことや、米国債券市場において景気後退の予兆とされる長短金利の逆転現象が見られたことなどを受け、下落して始まりしました。2019年1月以降は、米中通商協議の進展期待や米国企業を中心とした良好な1-3月決算の発表などを好感し、上昇しました。5月からは、米中関係の緊張が続いたことや世界的な景気減速懸念などを嫌気し、下落しました。6月以降は、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。当作成期末にかけては、再度米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると円高となりました。

当作成期首より、株価や原油価格が下落する中で市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。2019年1月に入ると、FRB（米国連邦準備制度理事会）が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり、市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

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（MSCIコクサイ指数（円ベース））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

(2018. 12. 1 ~ 2019. 12. 2)

■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、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。

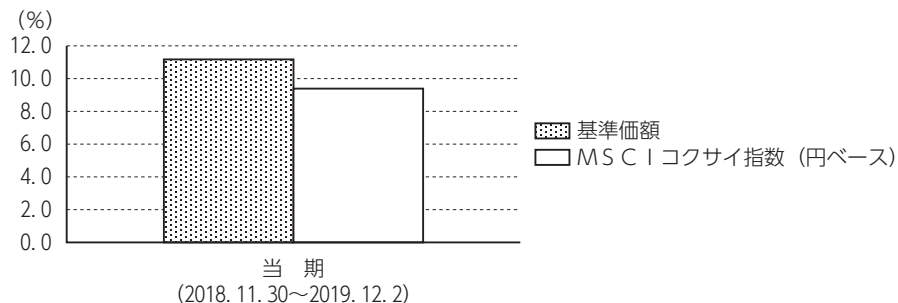
ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は9.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は11.2%となりました。

当ファンドが組み入れているマザーファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。

その他、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。



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	
	2018年12月1日 ～2019年12月2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）	7,187

（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。



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 (2018. 12. 1～2019. 12. 2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	94円	0. 599%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は15,709円です。
(投 信 会 社)	(49)	(0. 310)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(40)	(0. 256)	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 銀 行)	(5)	(0. 033)	受託銀行分は、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 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. 003)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 001)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	1	0. 007	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 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. 007)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	5	0. 034	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)	(4)	(0. 028)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 004)	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. 002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	101	0. 644	

(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。

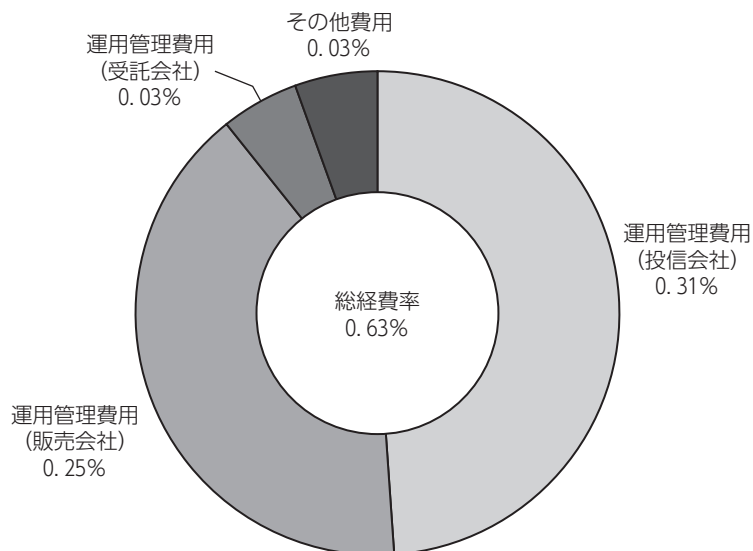
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.63%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。

D－I's 外国株式インデックス

■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

(2018年12月1日から2019年12月2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 インデックス マザーファンド	3,020	7,615	5,794	14,971

(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

(2018年12月1日から2019年12月2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	19,867,583千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	109,147,375千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.18

(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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■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 マザーファンド	5,542	2,768	7,586

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2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 マザーファンド	7,586	99.5
コール・ローン等、その他	39	0.5
投資信託財産総額	7,626	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.68円、1カナダ・ドル＝82.62円、1オーストラリア・ドル＝74.25円、1香港・ドル＝14.01円、1シンガポール・ドル＝80.21円、1ニュージーランド・ドル＝70.63円、1イギリス・ポンド＝141.59円、1イスラエル・シェケル＝31.56円、1スイス・フラン＝109.59円、1デンマーク・クローネ＝16.17円、1ノルウェー・クローネ＝11.90円、1スウェーデン・クローネ＝11.46円、1ユーロ＝120.86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（127,572,094千円）の投資信託財産総額（134,104,169千円）に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	7,626,325円
コール・ローン等	39,560
外国株式インデックス マザーファンド（評価額）	7,586,465
未収入金	300
(B)負債	39,262
未払信託報酬	38,968
その他未払費用	294
(C)純資産総額（A－B）	7,587,063
元本	4,414,396
次期繰越損益金	3,172,667
(D)受益権総口数	4,414,396口
1万口当り基準価額（C／D）	17,187円

* 期首における元本額は8,782,225円、当作成期間中における追加設定元本額は5,010,991円、同解約元本額は9,378,820円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,187円です。

■損益の状況

当期 自 2018年12月 1 日 至 2019年12月 2 日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	683,883円
売買益	1,255,151
売買損	△ 571,268
(B) 信託報酬等	△ 79,478
(C) 当期損益金 (A + B)	604,405
(D) 前期繰越損益金	45,544
(E) 追加信託差損益金	2,522,718
(配当等相当額)	(1,822,950)
(売買損益相当額)	(699,768)
(F) 合計 (C + D + E)	3,172,667
次期繰越損益金 (F)	3,172,667
追加信託差損益金	2,522,718
(配当等相当額)	(1,822,950)
(売買損益相当額)	(699,768)
分配準備積立金	649,949

- (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	604,405
(c) 収益調整金	2,522,718
(d) 分配準備積立金	45,544
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	3,172,667
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	3,172,667
(h) 受益権総口数	4,414,396口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第20期（決算日 2019年12月2日）

（作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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。

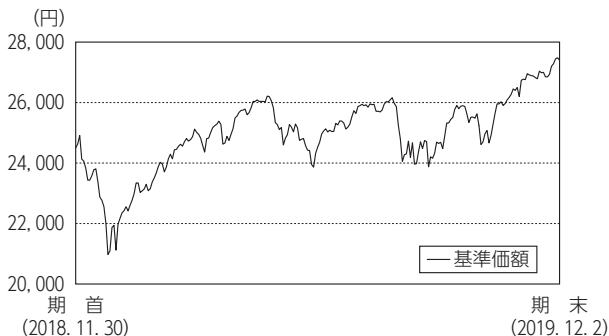
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証券を含みます。）
株式組入制限	無制限

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
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 (円ベース)		株 式	株 式	投資信託
	騰落率		ベンチマーク	騰落率	組入比率	先物比率	証券組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首) 2018年11月30日	24,496	—	16,678	—	95.1	2.3	2.6
12月末	21,941	△10.4	14,911	△10.6	96.2	1.2	2.7
2019年1月末	23,373	△4.6	15,850	△5.0	96.1	1.2	2.7
2月末	24,775	1.1	16,795	0.7	96.2	1.1	2.7
3月末	24,945	1.8	16,870	1.2	95.8	1.6	2.8
4月末	26,060	6.4	17,595	5.5	96.4	0.9	2.7
5月末	24,412	△0.3	16,406	△1.6	96.0	1.1	2.8
6月末	25,291	3.2	16,972	1.8	95.8	1.6	2.8
7月末	25,979	6.1	17,414	4.4	95.7	1.5	2.7
8月末	24,692	0.8	16,519	△1.0	95.1	2.0	2.9
9月末	25,483	4.0	17,023	2.1	95.8	1.2	3.0
10月末	26,498	8.2	17,659	5.9	91.1	6.1	2.8
11月末	27,482	12.2	18,297	9.7	90.6	6.6	2.7
(期末) 2019年12月2日	27,400	11.9	18,243	9.4	90.5	6.7	2.7

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数(円ベース)は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(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として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、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 Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。

(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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《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：24,496円 期末：27,400円 騰落率：11.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク(MSCIコクサイ指数(円ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする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、米中関係悪化への懸念が高まったことや、米国債券市場において景気後退の予兆とされる長短金利の逆転現象が見られたことを受け、下落して始まりしました。2019年1月以降は、米中通商協議の進展期待や米国企業を中心とした良好な1-3月決算の発表などを好感し、上昇しました。5月からは、米中関係の緊張が続いたことや世界的な景気減速懸念などを嫌気し、下落しました。6月以降は、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU(欧州連合)離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。当作成期末にかけては、再度米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると円高となりました。

当作成期首より、株価や原油価格が下落する中で市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。2019年1月に入ると、FRB(米国連邦準備制度理事会)が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり、市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU(欧州連合)離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後の運用にあたりましても、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、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

ベンチマークの騰落率は9.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は11.9%となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が生じたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。

その他、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。

《今後の運用方針》

今後の運用にあたりましても、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。

外国株式インデックスマザーファンド

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 (1) (0) (0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	2 (2) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	7 (7) (0)
合 計	10

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の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 (2018年12月 1 日から2019年12月 2 日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 11,284.7 (91.07)	千アメリカ・ドル 87,440 (△ 2,352)	百株 5,036.19	千アメリカ・ドル 33,749
	カナダ	百株 2,159 (△ 105.59)	千カナダ・ドル 8,134 (△ 292)	百株 1,118	千カナダ・ドル 2,686
	オーストラリア	百株 2,768.05 (△ 317.2)	千オーストラリア・ドル 4,668 (△ 442)	百株 931.73	千オーストラリア・ドル 1,768
	香港	百株 3,954 (286.09)	千香港・ドル 16,635 (ー)	百株 3,702	千香港・ドル 6,967
	シンガポール	百株 1,359 (ー)	千シンガポール・ドル 704 (ー)	百株 1,899	千シンガポール・ドル 261
	ニュージーランド	百株 380 (ー)	千ニュージーランド・ドル 295 (ー)	百株 ー	千ニュージーランド・ドル ー
	イギリス	百株 10,885.98 (625.28)	千イギリス・ポンド 6,843 (△ 174)	百株 3,744.24	千イギリス・ポンド 3,634
	イスラエル	百株 441 (ー)	千イスラエル・シケル 882 (ー)	百株 483	千イスラエル・シケル 117
	スイス	百株 548.45 (118.8)	千スイス・フラン 3,988 (△ 153)	百株 148.5	千スイス・フラン 1,287

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 142.3 (5.3)	千デンマーク・クローネ 6,073 (ー)	百株 77.3	千デンマーク・クローネ 2,681
	ノルウェー	百株 201 (24)	千ノルウェー・クローネ 2,524 (ー)	百株 117	千ノルウェー・クローネ 1,827
	スウェーデン	百株 809 (151)	千スウェーデン・クローネ 11,020 (ー)	百株 369.5	千スウェーデン・クローネ 4,038
	ユーロ (アイルランド)	百株 68.5 (ー)	千ユーロ 261 (ー)	百株 9	千ユーロ 27
	ユーロ (オランダ)	百株 1,022.6 (△ 7.62)	千ユーロ 2,968 (△ 53)	百株 154	千ユーロ 601
	ユーロ (ベルギー)	百株 63.5 (ー)	千ユーロ 574 (ー)	百株 14	千ユーロ 111
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 323.3 (ー)	千ユーロ 288 (ー)	百株 10	千ユーロ 42
	ユーロ (フランス)	百株 860.1 (23.48)	千ユーロ 4,455 (△ 3)	百株 316	千ユーロ 1,505
	ユーロ (ドイツ)	百株 864.4 (21.24)	千ユーロ 3,656 (△ 105)	百株 405.2	千ユーロ 1,606
	ユーロ (ポルトガル)	百株 110 (ー)	千ユーロ 61 (ー)	百株 ー	千ユーロ ー
	ユーロ (スペイン)	百株 1,873 (4,550.2)	千ユーロ 1,482 (115)	百株 5,170.2	千ユーロ 677
	ユーロ (イタリア)	百株 1,853 (ー)	千ユーロ 841 (ー)	百株 994	千ユーロ 503
	ユーロ (フィンランド)	百株 358.5 (81.85)	千ユーロ 468 (ー)	百株 138.85	千ユーロ 126
	ユーロ (オーストリア)	百株 50 (ー)	千ユーロ 178 (△ 11)	百株 8	千ユーロ 24
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 7,446.9 (4,669.15)	千ユーロ 15,236 (△ 58)	百株 7,219.25	千ユーロ 5,226

(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) 投資信託証券

(2018年12月 1 日から2019年12月 2 日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	アメリカ	千口 91.22 (2.4)	千アメリカ・ドル 4,522 (—)	千口 13.479 (—)	千アメリカ・ドル 879 (—)
	カナダ	千口 3.8 (—)	千カナダ・ドル 173 (—)	千口 — (—)	千カナダ・ドル — (—)
	オーストラリア	千口 86 (—)	千オーストラリア・ドル 665 (—)	千口 6.4 (—)	千オーストラリア・ドル 90 (—)
	香港	千口 24 (—)	千香港・ドル 692 (—)	千口 — (—)	千香港・ドル — (—)
	シンガポール	千口 95.5 (12.16)	千シンガポール・ドル 233 (△ 2)	千口 12.16 (—)	千シンガポール・ドル 3 (—)
国	イギリス	千口 14.55 (—)	千イギリス・ポンド 89 (—)	千口 22.2 (—)	千イギリス・ポンド 61 (—)
	ユーロ (フランス)	千口 1.79 (—)	千ユーロ 152 (—)	千口 0.25 (—)	千ユーロ 31 (—)

(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) 売付 () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2018年12月 1 日から2019年12月 2 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	株式先物取引	百万円 25,361	百万円 19,425	百万円 —	百万円 —

(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

(2018年12月 1 日から2019年12月 2 日まで)

当 期				期 付			
買 付		売		買 付		売	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
MICROSOFT CORP (アメリカ)	千株 25	千円 346,644	円 13,865	CELGENE CORP (アメリカ)	千株 21.25	千円 249,796	円 11,755
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.57	311,915	198,672	APPLE INC (アメリカ)	8.3	188,085	22,660
APPLE INC (アメリカ)	10.85	226,791	20,902	SHIRE PLC (ジャージー)	24.324	154,583	6,355
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	8.1	156,863	19,365	MICROSOFT CORP (アメリカ)	8.55	124,832	14,600
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO (アメリカ)	25.8	153,804	5,961	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.54	106,160	196,593
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.99	121,219	122,444	ORACLE CORP (アメリカ)	15.8	92,082	5,827
PROSUS NV (オランダ)	14.5	120,665	8,321	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	6.8	86,288	12,689
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.97	119,436	123,130	CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)	11.8	65,328	5,536
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	8.1	117,384	14,491	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	4.75	58,661	12,349
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A (アメリカ)	19	111,097	5,847	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	2.9	57,912	19,969

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

■組入資産明細表

(1) 外国株式

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	
(アメリカ)						
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO		30.5	33	408	44,776	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC		25	28.5	647	71,026	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN		48	55.5	594	65,151	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS		—	41	298	32,719	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		16	16	241	26,519	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL		188	185	692	75,907	金融
ABBOTT LABORATORIES		456.66	499.16	4,265	467,820	ヘルスケア
ARCONIC INC		113.33	111.33	344	37,804	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC		41.5	43.5	641	70,363	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP		105	98	614	67,447	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A		78	85.5	889	97,527	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		84.79	173.62	2,398	263,074	情報技術
QORVO INC		34	34	354	38,861	情報技術
AFLAC INC		203	216	1,184	129,920	金融
DARDEN RESTAURANTS INC		31.5	36.5	432	47,415	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN		39	42	293	32,158	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC		127.8	137.5	4,256	466,802	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		59.5	64.5	298	32,690	素材
LULULEMON ATHLETICA INC		26	31	699	76,736	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		100	113	186	20,449	金融
GARMIN LTD		29	39	380	41,787	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC		58	61.3	1,448	158,893	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		192	205.5	3,669	402,438	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		41.71	—	—	—	その他
WR BERKLEY CORP		25.5	41.75	283	31,138	金融
AUTOZONE INC		7	7.3	859	94,311	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC		63.21	69.71	637	69,928	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		257	314	327	35,885	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL		29.5	32	279	30,671	公益事業
CELANESE CORP		35.5	35	439	48,203	素材
DR HORTON INC		94.16	101.16	559	61,412	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		24.5	24.5	75	8,297	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC		59	70	395	43,409	ヘルスケア
AUTODESK INC		57.5	61	1,103	121,030	情報技術
MOODY'S CORP		44.5	48	1,088	119,333	金融
DEVON ENERGY CORP		139.5	116.5	255	27,970	エネルギー
ALBEMARLE CORP		28	31.5	205	22,588	素材
ATMOS ENERGY CORP		28	33.5	358	39,300	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP		62.5	67	355	38,947	公益事業
CITIGROUP INC		660.73	653.73	4,910	538,618	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING		115	122.5	2,092	229,456	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER		130	142.5	1,301	142,774	公益事業
ALLEGHANY CORP		4.1	4.1	319	35,077	金融
DOMINO'S PIZZA INC		11	11	323	35,506	一般消費財・サービス
HESS CORP		72	78	484	53,118	エネルギー
DAVITA INC		35	35	251	27,551	ヘルスケア
DANAHER CORP		163	182	2,656	291,401	ヘルスケア
FORTIVE CORP		78	87	627	68,865	資本財・サービス
AVNET INC		32	—	—	—	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		151.5	162.5	1,530	167,839	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		49	49	92	10,152	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		47.28	56.28	97	10,678	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		143.5	158	678	74,395	生活必需品
BUNGE LTD		36	40	213	23,418	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD		89.25	98.25	910	99,904	情報技術

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	
APPLE INC		1,272.5	1,298	34,689	3,804,695	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		90	94	797	87,500	金融
BOEING CO/THE		143.1	149.9	5,489	602,037	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		39.15	44.65	477	52,424	金融
BECTON DICKINSON AND CO		70.19	76.49	1,977	216,866	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		67	67	142	15,637	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		38.5	38.5	349	38,358	情報技術
CDK GLOBAL INC		32	36	192	21,144	情報技術
NISOURCE INC		93.5	110.5	292	32,056	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		36	38.5	295	32,451	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		265.21	243.21	1,190	130,628	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		1,074.54	1,169.04	7,042	772,399	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		334.5	363.5	8,007	878,307	金融
ANSYS INC		22.5	24.5	623	68,439	情報技術
H&R BLOCK INC		51	—	—	—	一般消費財・サービス
BB&T CORP		200	215.5	1,179	129,336	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A		—	190	1,030	112,990	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		421.5	668.5	3,806	417,490	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO		877.7	910.7	11,999	1,316,092	金融
T ROWE PRICE GROUP INC		63	69.5	858	94,186	金融
CIGNA HOLDING CO		64	—	—	—	その他
LKQ CORP		85	94	331	36,373	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		10	13.5	254	27,885	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		68.62	90.62	614	67,407	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC		72.5	83	583	63,951	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC		38.1	38.1	624	68,478	金融
DOLLAR GENERAL CORP		69.5	75	1,180	129,444	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC		46.5	51.6	1,460	160,186	情報技術
CATERPILLAR INC		155.5	162	2,344	257,158	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC		—	70	264	28,975	金融
AQUA AMERICA INC		—	63	278	30,589	公益事業
CMS ENERGY CORP		72	82	502	55,131	公益事業
MOSAIC CO/THE		97.5	109.5	208	22,878	素材
DELTA AIR LINES INC		47.5	47.5	272	29,857	資本財・サービス
CORNING INC		213	232	673	73,894	情報技術
CISCO SYSTEMS INC		1,222.5	1,210.5	5,484	601,570	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC		—	37	236	25,955	ヘルスケア
MORGAN STANLEY		346	356.5	1,763	193,471	金融
WABCO HOLDINGS INC		14	15.5	208	22,908	資本財・サービス
MSCI INC		23	24.5	635	69,648	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC		10	10	255	28,061	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP		14.5	16	185	20,314	資本財・サービス
COTY INC-CL A		118.39	84.39	97	10,681	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		56	65	390	42,810	情報技術
BROADCOM INC		108.02	111.22	3,516	385,732	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP		10.5	—	—	—	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC		10	11.5	150	16,495	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		24.3	33.3	390	42,783	ヘルスケア
ARAMARK		64.5	70.5	307	33,744	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		53.5	60.5	172	18,891	素材
DTE ENERGY COMPANY		46.5	52.5	655	71,942	公益事業
CENTENE CORP		54.5	121.5	734	80,583	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		30	32	380	41,731	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP		129	130.5	501	55,048	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO		46.5	53.5	498	54,729	金融
GARTNER INC		23.5	27.2	436	47,869	情報技術
SPLUNK INC		38	45	671	73,649	情報技術
AGCO CORP		17	—	—	—	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	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	
DOMINION ENERGY INC	172	226.41	1,881	206,384	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	111	117	699	76,764	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	36.5	41.5	200	22,030	資本財・サービス
DEERE & CO	80	87.5	1,470	161,277	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	42.5	81.84	1,482	162,559	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	19.5	25	389	42,671	情報技術
CHEMOURS CO/THE	45.5	—	—	—	素材
BURLINGTON STORES INC	—	19	427	46,888	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	31.5	34.5	361	39,655	金融
VAIL RESORTS INC	10.2	11.2	271	29,809	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	36.5	41	187	20,604	金融
TARGA RESOURCES CORP	58.5	65.5	239	26,243	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	16.5	18	297	32,665	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	19.8	21.8	239	26,231	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	10.5	72	7,909	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	80	92	799	87,676	公益事業
COGNEX CORP	45.5	50.5	253	27,793	情報技術
TELEFLEX INC	12.3	13.3	469	51,543	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	23	26	300	32,971	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	22	323	35,477	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	6.5	240	26,333	ヘルスケア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	15.2	489	53,693	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	31.5	38	566	62,175	ヘルスケア
IDEX CORP	19.5	22.5	366	40,160	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	216.5	230.5	1,563	171,457	生活必需品
ROLLINS INC	25.5	43.25	155	17,006	資本財・サービス
AMETEK INC	61.75	65.25	646	70,857	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	65	73.5	516	56,623	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	32	36.5	135	14,808	資本財・サービス
HEICO CORP	—	12	155	17,095	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	25.5	210	23,127	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	11.5	298	32,750	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	85.5	75	694	76,123	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	11	319	35,008	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	114	124	3,717	407,751	生活必需品
SCANA CORP	35	—	—	—	その他
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	24	292	32,069	情報技術
GRUBHUB INC	—	26	112	12,296	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	—	16.5	349	38,338	情報技術
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13.5	—	—	—	金融
RPM INTERNATIONAL INC	—	38	280	30,729	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.5	6.9	561	61,596	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	76	69.5	145	15,931	金融
UGI CORP	46	52	226	24,838	公益事業
CUMMINS INC	40.5	43.5	795	87,243	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	191.5	215.5	1,181	129,596	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	68.5	76.5	171	18,819	情報技術
CDW CORP/DE	40.5	43.5	587	64,433	情報技術
SIGNATURE BANK	15	15	185	20,295	金融
COSTAR GROUP INC	9.7	9.9	606	66,546	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	13.9	14.9	345	37,870	金融
AMERCO	2.2	2.2	79	8,740	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16.5	18.5	354	38,875	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	10.9	12.7	737	80,871	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	95	110	165	18,181	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19.5	23	349	38,328	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	74.16	81.66	857	94,042	一般消費財・サービス
COMMScope HOLDING CO INC	46	—	—	—	情報技術

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			当		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
IPG PHOTONICS CORP	10.2	10.2	144	15,896	情報技術
DEXCOM INC	—	27	613	67,314	ヘルスケア
COPART INC	54	58.5	520	57,104	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	26.5	46.5	359	39,444	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	29	32.5	391	42,899	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	19.5	22.7	629	69,050	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12.8	13.3	754	82,725	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	26	303	33,253	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	90	99	193	21,228	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	509.81	575.81	1,129	123,846	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	73.5	79	1,095	120,145	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	11.5	464	50,934	金融
CABOT OIL & GAS CORP	120.5	120.5	192	21,067	エネルギー
T-MOBILE US INC	90	100	785	86,153	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	29	34.5	135	14,814	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,051	1,141.5	6,095	668,566	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	57.5	71	358	39,294	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	45.5	48.5	362	39,768	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	30.5	30.5	143	15,779	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	86.5	86.5	237	26,080	金融
CSX CORP	214	221.5	1,584	173,800	資本財・サービス
FLUOR CORP	36.5	—	—	—	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	26	26.8	461	50,643	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	32.25	40.75	414	45,436	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	21.5	24	196	21,511	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	107.4	117.7	21,195	2,324,713	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	66.5	—	—	—	エネルギー
FLOWSERVE CORP	32	35.5	172	18,962	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	54.5	60	1,469	161,190	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,099.05	1,196.55	8,152	894,121	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	34	37.5	200	22,029	情報技術
AES CORP	170	201	380	41,688	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	20.5	—	—	—	その他
EVEREST RE GROUP LTD	10.2	12.4	336	36,892	金融
EOG RESOURCES INC	152.5	164	1,162	127,531	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	44.5	48.5	422	46,343	情報技術
ABIOMED INC	10.8	12.9	253	27,756	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	42.5	46.5	408	44,835	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	83.9	92.4	746	81,855	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	956.23	1,109.23	1,004	110,224	一般消費財・サービス
MACY'S INC	80.98	—	—	—	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	39.9	46.9	154	16,944	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	—	37	299	32,875	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	48.87	110	12,086	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	79.89	100.89	307	33,772	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	34	40	247	27,117	資本財・サービス
FORTINET INC	38	41.5	436	47,843	情報技術
MARKEL CORP	3.6	4.1	465	51,064	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	44	—	—	—	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	122.5	135.5	3,168	347,494	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	364.08	434.08	493	54,180	素材
INSULET CORP	—	17.5	324	35,643	ヘルスケア
US BANCORP	403.5	428	2,569	281,799	金融
UNITED RENTALS INC	21.5	23	352	38,609	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	17.5	254	27,967	情報技術
FASTENAL CO	77	163	578	63,502	資本財・サービス
FISERV INC	107	161.63	1,878	206,065	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,263.5	2,468.5	2,781	305,129	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	
NEKTAR THERAPEUTICS		44. 5	—	—	—	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		56	61	327	35, 887	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO		60. 5	—	—	—	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO		334	361	1, 299	142, 540	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC		27. 5	33	93	10, 279	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP		66	69	1, 254	137, 539	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC		93. 4	92. 9	2, 056	225, 539	金融
ALPHABET INC-CL A		77. 6	84	10, 954	1, 201, 473	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C		81. 77	87. 47	11, 414	1, 251, 940	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING		27. 5	31. 5	211	23, 168	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC		156. 5	168. 5	898	98, 541	生活必需品
FIRSTENERGY CORP		125. 68	152. 68	728	79, 861	公益事業
GENUINE PARTS CO		37. 5	43	448	49, 223	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD		101. 84	106. 34	772	84, 734	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP		176	207	624	68, 542	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		30. 5	64. 1	1, 288	141, 376	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		30	30	86	9, 456	資本財・サービス
HALLIBURTON CO		234	248	520	57, 094	エネルギー
HOME DEPOT INC		298. 5	310	6, 835	749, 751	一般消費財・サービス
ASSURANT INC		14	17. 5	232	25, 503	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC		294	299	445	48, 830	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		11. 9	11. 9	299	32, 847	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE		37. 5	43. 5	644	70, 688	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC		44. 5	44. 5	161	17, 756	一般消費財・サービス
HUMANA INC		36	38. 3	1, 306	143, 341	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV		89. 5	81. 5	941	103, 316	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A		—	21	362	39, 724	情報技術
HELMERICH & PAYNE		29	—	—	—	エネルギー
HENRY SCHEIN INC		40. 5	45	310	34, 006	ヘルスケア
HP INC		433	426	855	93, 821	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		394	394	623	68, 407	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		48	48	232	25, 538	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP		43	47	242	26, 573	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		54. 5	60	270	29, 672	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		21	25	121	13, 353	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD		103. 5	119	499	54, 778	金融
KRAFT HEINZ CO/THE		161. 53	198. 53	605	66, 413	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP		238. 5	250	3, 361	368, 661	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO		100	107	495	54, 383	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		36	40	253	27, 753	資本財・サービス
ZOETIS INC		126. 5	135. 5	1, 633	179, 112	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC		65. 79	69. 79	915	100, 359	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC		54. 5	65. 5	396	43, 492	エネルギー
ALLEGION PLC		24. 5	26. 5	318	34, 886	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC		35	35	183	20, 084	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C		136. 73	117. 73	253	27, 762	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC		68. 57	75. 57	684	75, 052	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC		89	96. 5	241	26, 523	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC		—	22	247	27, 143	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE		29. 2	34. 2	359	39, 419	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON		696	748	10, 284	1, 127, 976	ヘルスケア
ABBVIE INC		394. 29	417. 79	3, 665	402, 006	ヘルスケア
HOLOGIC INC		71	75. 5	387	42, 497	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP		89. 5	99. 5	1, 356	148, 790	生活必需品
KROGER CO		218. 5	229. 5	627	68, 819	生活必需品
KLA CORP		41	46. 5	761	83, 570	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP		66. 7	71. 7	2, 803	307, 508	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		23. 2	25. 6	785	86, 177	情報技術

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	千アメリカ・ドル	千円	
L BRANDS INC	59	—	—	—	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	212	224.5	2,633	288,854	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	252.5	246.05	2,887	316,689	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	42.3	42.3	1,128	123,794	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	12.5	14.5	241	26,452	不動産
LOEWS CORP	72.5	79	402	44,103	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	57.99	57.99	342	37,557	金融
MCDONALD'S CORP	203.5	216	4,200	460,740	一般消費財・サービス
3M CO	153.5	162.5	2,758	302,581	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	624.5	676.5	13,640	1,496,138	コミュニケーション・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	51.04	—	—	—	情報技術
MANPOWERGROUP INC	16	17.8	164	18,086	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	65	69.8	1,847	202,607	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	16	18.4	493	54,166	素材
CONCHO RESOURCES INC	52.5	58	420	46,158	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	134.5	—	—	—	その他
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	53	66	225	24,785	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	116	128.5	1,474	161,684	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	111.5	121	227	25,003	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	134	144.5	461	50,636	一般消費財・サービス
MATTEL INC	87	—	—	—	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	73.38	77.88	290	31,886	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	32	33.5	566	62,187	生活必需品
MYLAN NV	137.5	148.5	278	30,587	ヘルスケア
METLIFE INC	227	235	1,172	128,642	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	157	181	477	52,349	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	13.9	15.1	294	32,316	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	42	48	216	23,701	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	42.78	47.78	799	87,673	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.4	6.4	460	50,499	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	132.73	144.73	324	35,589	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	32.3	33.8	661	72,601	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	29.4	—	—	—	金融
MERCK & CO. INC.	696.21	727.21	6,339	695,351	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	598.55	211.68	1,371	150,469	素材
MASCO CORP	79	86	400	43,908	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.19	35.69	587	64,487	金融
MARSH & MCLENNAN COS	132.5	144.5	1,561	171,277	金融
BLACK KNIGHT INC	—	44	277	30,408	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	—	23	231	25,337	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	77.22	78.72	1,104	121,186	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	37.5	48	859	94,300	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	—	18.5	157	17,230	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	77.5	101	698	76,568	情報技術
TRANSUNION	47	55	474	52,065	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	87	100.5	266	29,243	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	38.5	44.5	165	18,127	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	79.5	—	—	—	その他
BEIGENE LTD-ADR	—	10.5	213	23,411	ヘルスケア
NETAPP INC	68.5	74.5	451	49,509	情報技術
NIKE INC -CL B	332	355.5	3,323	364,529	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	74	75	1,451	159,173	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	60	68	642	70,510	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34.5	37.5	336	36,942	金融
ALLY FINANCIAL INC	114.5	114.5	364	39,985	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	43	44.5	1,565	171,690	資本財・サービス
APTIV PLC	68.5	72	675	74,136	一般消費財・サービス
NEWMONT GOLDCORP CORP	140	231.61	889	97,547	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	
MCKESSON CORP		53	55.5	802	88,045	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		71	81	459	50,346	情報技術
XYLEM INC		48	51.5	399	43,781	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		404.5	440.5	3,653	400,668	生活必需品
NUCOR CORP		82	87	490	53,779	素材
WESTERN UNION CO		117.46	129.46	347	38,167	情報技術
GODADDY INC - CLASS A		45	53	351	38,586	情報技術
NEWELL BRANDS INC		122.92	122.92	236	25,912	一般消費財・サービス
EVERGY INC		69.5	68.5	433	47,535	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		197	257.24	992	108,821	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		—	7	118	12,998	金融
OKTA INC		—	30	389	42,702	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C		28.5	31.5	376	41,282	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		—	107.05	296	32,534	ヘルスケア
LINDE PLC		147.96	152.96	3,154	345,951	素材
WIX.COM LTD		—	14.5	175	19,225	情報技術
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC		—	83	205	22,521	金融
KKR & CO INC -A		—	147	433	47,546	金融
PAYCHEX INC		83.5	93.5	805	88,316	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		21.2	22	973	106,720	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC		491	528.5	2,626	288,090	生活必需品
P G & E CORP		132.5	—	—	—	公益事業
PFIZER INC		1,520.13	1,571.13	6,051	663,782	ヘルスケア
ALKERMES PLC		40	—	—	—	ヘルスケア
CIGNA CORP		—	106.8	2,135	234,182	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C		—	45.51	220	24,203	情報技術
ALTICE USA INC- A		—	41	104	11,503	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC		131.5	148.5	913	100,151	公益事業
STERIS PLC		—	25	377	41,442	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B		—	48.33	169	18,542	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A		—	99.99	357	39,217	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP		87	95	1,946	213,455	ヘルスケア
DOW INC		—	210.68	1,124	123,324	素材
PARKER HANNIFIN CORP		35	37.5	745	81,762	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC		—	52	153	16,881	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		45	46.5	594	65,199	エネルギー
POLARIS INC		15.5	15.5	151	16,609	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE		650.67	707.67	8,637	947,396	生活必需品
EXELON CORP		254.72	273.72	1,215	133,295	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		57.5	66	752	82,479	ヘルスケア
NVR INC		0.9	1	379	41,589	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS		303	319	1,912	209,717	エネルギー
TWILIO INC - A		—	31.5	325	35,682	情報技術
DOCUSIGN INC		—	29	206	22,649	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC		—	14	387	42,504	情報技術
MATCH GROUP INC		—	18	126	13,914	コミュニケーション・サービス
PEPSICO INC		366	395.5	5,372	589,209	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		—	11	134	14,785	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A		—	52	96	10,545	情報技術
MONGODB INC		—	12.5	185	20,386	情報技術
SNAP INC - A		—	208	317	34,790	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC		—	215.68	561	61,552	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		110	118	1,104	121,165	金融
AMCOR PLC		—	479	491	53,902	素材
ROKU INC		—	24	384	42,214	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC		48.5	51.5	623	68,364	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A		167	180.8	3,636	398,903	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		22	—	—	—	金融

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	千アメリカ・ドル	千円	
PENTAIR PLC	42.05	47.05	208	22,886	資本財・サービス
QUALCOMM INC	369.5	343.5	2,869	314,775	情報技術
INVESCO LTD	109.5	109.5	192	21,089	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	19	20.5	322	35,318	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	72	83.5	460	50,462	金融
PINTEREST INC- CLASS A	—	45	87	9,614	コミュニケーション・サービス
RAYTHEON COMPANY	75.2	79.2	1,721	188,865	資本財・サービス
DISH NETWORK CORP-RTS	—	3.49	0	26	コミュニケーション・サービス
RED HAT INC	45.5	—	—	—	その他
REGENERON PHARMACEUTICALS	20.9	22	811	89,038	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	60	67.5	598	65,631	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	12.5	12.3	2,341	256,865	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	99.5	107	1,242	136,310	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	24	26.5	296	32,523	素材
RESMED INC	37	41.5	620	68,093	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	35.5	38	404	44,408	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	30.5	33.5	194	21,384	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	14.5	14.5	155	17,070	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	—	31	287	31,586	ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	302.35	503	55,181	金融
CHEVRON CORP	497.18	538.18	6,303	691,390	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	83	103	711	78,062	公益事業
TESLA INC	33	37.7	1,243	136,428	一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	161.5	184.5	459	50,387	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	39.22	44.22	697	76,504	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	37.5	43.5	613	67,291	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	45.05	44.15	2,075	227,596	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	87	91.5	521	57,223	不動産
TWITTER INC	179	211.5	653	71,702	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	266.5	293.5	1,819	199,552	公益事業
SYSCO CORP	127	137	1,103	121,035	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	71.23	73.03	998	109,511	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	35.5	39.5	254	27,956	金融
STERICYCLE INC	21.5	—	—	—	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	62	62	209	22,936	素材
SCHLUMBERGER LTD	359.02	392.02	1,419	155,648	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	46	46	236	25,978	資本財・サービス
AT&T INC	1,887.91	2,065.91	7,722	846,989	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	36.5	40.5	233	25,603	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	110	123	264	28,964	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21.9	23.3	1,358	149,021	素材
SEMPRA ENERGY	64.5	79	1,163	127,605	公益事業
TIFFANY & CO	29.5	32.5	434	47,694	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70.5	71	423	46,474	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	253	265	3,185	349,392	情報技術
SALESFORCE.COM INC	186	234.21	3,815	418,434	情報技術
WESTROCK CO	66.3	71.3	287	31,538	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	238.84	229.84	984	107,969	資本財・サービス
TERADYNE INC	—	50	312	34,324	情報技術
UNION PACIFIC CORP	201.5	199.5	3,511	385,086	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	226	248	288	31,688	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	178.38	193.88	1,175	128,949	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	214.37	231.37	3,432	376,437	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	179	197	2,358	258,700	資本財・サービス
UNUM GROUP	59	59	181	19,892	金融
SPRINT CORP	207.65	231.65	137	15,041	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	51	—	—	—	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	41.94	48.94	714	78,358	ヘルスケア

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	
VOYA FINANCIAL INC		43.5	43.5	253	27,805	金融
AMEREN CORPORATION		62.5	72	535	58,698	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC		249.76	267.76	7,493	821,919	ヘルスケア
VERISIGN INC		29	30	572	62,761	情報技術
VALERO ENERGY CORP		112.92	117.42	1,121	122,977	エネルギー
ULTA BEAUTY INC		15.1	16.1	376	41,296	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL		68.38	81.88	389	42,774	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		23	25	348	38,248	ヘルスケア
ANTHEM INC		67.4	72.8	2,101	230,486	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE		387	509.12	7,717	846,426	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO		1,196.22	1,209.22	6,585	722,288	金融
WASTE MANAGEMENT INC		110.5	119.5	1,349	147,988	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC		319	347	788	86,469	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY		32	34.5	325	35,735	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP		17	19	271	29,820	一般消費財・サービス
WALMART INC		382	405	4,823	529,002	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A		29	29	252	27,669	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		53	58	842	92,419	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD		26	29	350	38,439	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP		59.11	59.11	230	25,239	情報技術
WABTEC CORP		22.5	54.11	425	46,629	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC		328	342.5	2,093	229,637	一般消費財・サービス
WATERS CORP		20.5	20.5	455	49,931	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC		18	18	167	18,320	資本財・サービス
ALLERGAN PLC		88.57	91.57	1,693	185,742	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A			16.5	414	45,413	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		220	220	1,311	143,812	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC		35.23	37.23	731	80,214	金融
WESTERN DIGITAL CORP		78	84	422	46,369	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC		82.8	90.8	804	88,286	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		134	146	865	94,974	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES		460.5	489.5	9,031	990,603	情報技術
PPL CORP		186	211	718	78,753	公益事業
PULTEGROUP INC		69	75	297	32,616	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC		64.5	67.5	869	95,385	素材
NORTHERN TRUST CORP		56.5	60	643	70,572	金融
NVIDIA CORP		150	163	3,532	387,484	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP		20.5	23.5	523	57,400	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		122.43	127.43	1,952	214,134	金融
QURATE RETAIL INC-SERIES A		114.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC		47	53	211	23,147	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A		79	83	746	81,830	生活必需品
NETFLIX INC		113.4	123.2	3,876	425,186	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		105	113	3,547	389,104	ヘルスケア
NRG ENERGY INC		—	79.5	315	34,642	公益事業
GLOBE LIFE INC		29.25	29.25	300	32,966	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA		42.5	48.5	533	58,461	金融
TEXTRON INC		68.5	68.5	316	34,740	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A		275	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B		116	—	—	—	その他
NEWS CORP - CLASS A		102.37	117.37	151	16,580	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP		53	59.5	250	27,448	公益事業
OMNICOM GROUP		60.5	64	508	55,791	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP		792.83	676.83	3,799	416,753	情報技術
MASTERCARD INC - A		240.5	255	7,451	817,320	情報技術
ONEOK INC		107.5	119	845	92,733	エネルギー
CENTURYLINK INC		253.52	294.52	426	46,806	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		27.2	30.2	1,088	119,366	資本財・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	
YUM! BRANDS INC	83	89.5	900	98,821	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	30.5	30.5	370	40,594	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13.3	13.3	142	15,595	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	50.5	56.5	285	31,282	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	124	145.5	302	33,129	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,491.01	2,554.01	8,509	933,372	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	10.5	359	39,384	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	46	52.5	423	46,474	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	114	12,559	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	190.5	200	2,402	263,495	金融
ANALOG DEVICES INC	95.49	106.49	1,202	131,923	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	238	291	1,139	124,954	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	72	83	430	47,183	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	230.22	245.22	1,291	141,632	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	135	—	—	—	その他
SKYWORKS SOLUTIONS INC	48	51.5	506	55,524	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	44.5	49.5	594	65,160	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	51	—	—	—	その他
AVERY DENNISON CORP	23	25	325	35,747	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	153.5	165	1,057	116,021	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	165.5	174	1,285	140,956	資本財・サービス
AON PLC	63	69.7	1,419	155,653	金融
AMGEN INC	172.5	173	4,060	445,372	ヘルスケア
TAPESTRY INC	76.5	83.5	224	24,626	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	115.36	121.36	1,122	123,124	資本財・サービス
CELGENE CORP	192	—	—	—	その他
CONSTELLATION BRANDS INC-A	43.3	46.8	870	95,505	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	263	272	1,574	172,732	情報技術
CIT GROUP INC	33	—	—	—	金融
CIMAREX ENERGY CO	25	—	—	—	エネルギー
CME GROUP INC	93.5	101	2,047	224,577	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	98.94	116.94	263	28,922	エネルギー
ECOLAB INC	68.5	75.5	1,409	154,578	素材
EQUIFAX INC	31.5	33.5	467	51,307	資本財・サービス
GAP INC/THE	59.5	59.5	98	10,839	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	336	359.5	2,417	265,127	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	77.5	83.5	371	40,781	生活必需品
STATE STREET CORP	97.43	109.43	821	90,137	金融
SUNTRUST BANKS INC	120.48	129.48	917	100,602	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	318	340	1,683	184,591	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	131	136	1,114	122,270	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	48.5	48.5	225	24,772	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	34.5	38.5	292	32,050	素材
CARDINAL HEALTH INC	83	90	495	54,321	ヘルスケア
FEDEX CORP	66	69	1,104	121,124	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	126.54	135.04	1,350	148,126	金融
FMC CORP	36	39.5	386	42,439	素材
FLEX LTD	129	147.5	175	19,203	情報技術
CERNER CORP	77.5	93.5	669	73,416	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	26.24	30.24	427	46,842	素材
CITRIX SYSTEMS INC	37	37	417	45,780	情報技術
INTEL CORP	1,205	1,266.5	7,352	806,370	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	102	115	257	28,253	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	91	103.5	640	70,222	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	79.5	94.5	1,647	180,688	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	417	461	321	35,292	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	38.7	40.4	1,295	142,131	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	44	166	18,208	素材

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	千アメリカ・ドル	千円	
INTUITIVE SURGICAL INC	29.7	32.1	1,903	208,743	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	34.5	34.5	406	44,605	情報技術
SNAP-ON INC	15.5	15.5	248	27,278	資本財・サービス
CARMAX INC	46	49.5	481	52,804	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	45	316	34,751	金融
INGREDION INC	19	19	158	17,331	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	183.78	205.28	1,809	198,515	公益事業
TARGET CORP	132.5	144	1,800	197,439	一般消費財・サービス
DOVER CORP	39	42.5	473	51,965	資本財・サービス
WWV GRAINGER INC	13	14	443	48,668	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	34	39.5	363	39,896	資本財・サービス
CINTAS CORP	23.5	26.2	673	73,869	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	127	138	398	43,697	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	41	344	37,764	生活必需品
CLOROX COMPANY	33	37.5	555	60,966	生活必需品
ENTERGY CORP	47.5	54	628	68,934	公益事業
MICROSOFT CORP	1,892	2,056.5	31,131	3,414,480	情報技術
INCYTE CORP	46	53.5	503	55,251	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	335.69	367.69	2,767	303,550	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	349.88	379.38	4,225	463,498	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	305.5	312	1,482	162,579	情報技術
BLACKROCK INC	31.3	32	1,583	173,701	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	129	149	365	40,136	公益事業
HASBRO INC	31	36	366	40,156	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	68.5	73	475	52,139	生活必需品
KEYCORP	282	299	579	63,588	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	27.5	30	457	50,152	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	384.61	406.61	2,136	234,312	生活必需品
KOHL'S CORP	44.5	49.5	232	25,522	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	13	14	438	48,075	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	120	—	—	—	金融
APACHE CORP	98.6	106.1	236	25,927	エネルギー
CHUBB LTD	120.49	129.49	1,961	215,138	金融
ARROW ELECTRONICS INC	21.5	24	191	20,963	情報技術
ALLSTATE CORP	92	96	1,068	117,243	金融
EBAY INC	249	233.5	829	90,967	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	293	315	3,402	373,165	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	37.5	41.5	325	35,671	素材
XILINX INC	65.5	71.5	663	72,759	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	147.1	—	—	—	その他
DISH NETWORK CORP-A	57.5	64.5	220	24,173	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	52	52	258	28,391	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	57.5	61	1,192	130,778	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	—	—	—	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	64	70.5	285	31,339	情報技術
LENNAR CORP-A	76	81	483	52,993	一般消費財・サービス
LEAR CORP	16.5	18	216	23,752	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	70	70	310	34,011	金融
PROGRESSIVE CORP	154	168	1,227	134,603	金融
PACCAR INC	91.37	100.37	816	89,576	資本財・サービス
PVH CORP	20	20	193	21,269	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	54.6	56.1	1,681	184,474	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	22.2	25.2	633	69,535	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	354.5	342.5	2,925	320,921	一般消費財・サービス
PTC INC	—	31.5	241	26,464	情報技術
PERRIGO CO PLC	34	38	194	21,351	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	81.3	88.8	733	80,487	公益事業
INTUIT INC	63	73.4	1,900	208,419	情報技術

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	
BORGWARNER INC		56	63	264	29,055	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		65	69	556	61,027	一般消費財・サービス
BALL CORP		87.34	91.84	606	66,542	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		360.47	392.97	1,699	186,411	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC		78.5	86.5	873	95,831	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO		34.5	36.5	517	56,795	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		66	72.5	1,607	176,331	ヘルスケア
VF CORP		87	95	841	92,255	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		88.71	100.71	406	44,603	コミュニケーション・サービス
VIACOM INC-CLASS B		92.71	100.71	242	26,587	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		15.7	17.2	239	26,292	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		24	26	347	38,135	ヘルスケア
CARNIVAL CORP		112	118.5	534	58,590	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A		1,188.9	1,281.9	5,659	620,743	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		61	67	212	23,331	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		59	67	376	41,313	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		90	90	52	5,774	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		313	353	194	21,294	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	79,569.2 592銘柄	85,908.78 612銘柄	762,122	83,589,601 <62.4%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD		76	83	276	22,807	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		5	6	852	70,392	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		50.96	59.96	82	6,786	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN		63.87	71.87	627	51,820	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		120	132	481	39,806	素材
INTACT FINANCIAL CORP		38.5	40.5	554	45,831	金融
BCE INC		41.3	45.3	289	23,930	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		51	57	744	61,536	素材
SUNCOR ENERGY INC		429.3	444.3	1,840	152,081	エネルギー
METRO INC/CN		62	77	447	37,012	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		90	95	675	55,844	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		318	346	2,592	214,227	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		118.5	125.5	1,449	119,718	金融
TORONTO-DOMINION BANK		483	516	3,952	326,517	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		76	83	277	22,938	金融
ROYAL BANK OF CANADA		383.5	405.5	4,409	364,271	金融
TOURMALINE OIL CORP		66	—	—	—	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		37	—	—	—	エネルギー
TC ENERGY CORP		238.5	261.5	1,757	145,186	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		132.29	146.29	678	56,057	エネルギー
BOMBARDIER INC-B		530	628	123	10,221	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP		304	514	1,140	94,191	素材
CAE INC		72	79	281	23,294	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		68.12	58.12	539	44,599	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'		46	53	188	15,575	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		16	16	92	7,636	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		38.5	46.5	264	21,825	素材
LINAMAR CORP		13	—	—	—	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		64	—	—	—	エネルギー
HYDRO ONE LTD		84	92	230	19,017	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		54.6	54.6	390	32,299	生活必需品
WSP GLOBAL INC		27	30	257	21,249	資本財・サービス
PARKLAND FUEL CORP		—	44	207	17,165	エネルギー

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	千カナダ・ドル	千円	
QUEBECOR INC -CL B	—	53	174	14,423	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	13	72	393	32,491	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	33	40	156	12,908	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	95	106	682	56,417	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	59	72	568	46,946	素材
STARS GROUP INC/THE	—	63	200	16,567	一般消費財・サービス
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	150	279	23,088	公益事業
AIR CANADA	—	41	205	16,954	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	341	379	217	17,973	素材
BANK OF MONTREAL	171	180	1,839	152,017	金融
POWER CORP OF CANADA	94	94	303	25,038	金融
METHANEX CORP	22	17	84	6,942	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	23	28	1,247	103,048	情報技術
NUTRIEN LTD	165.19	165.19	1,035	85,572	素材
AURORA CANNABIS INC	175	198	65	5,431	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	55	62	151	12,555	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	—	55	49	4,103	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	58	323	26,734	素材
CAMECO CORP	106	106	128	10,596	エネルギー
TELUS CORP	54	54	270	22,374	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	62	80	259	21,467	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	140	151	314	25,949	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	18	278	23,015	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	248	—	—	—	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	328	351	1,302	107,617	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7	8	480	39,658	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	87	92	673	55,624	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	20.37	22.37	241	19,968	生活必需品
BLACKBERRY LTD	135	160	117	9,689	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	158.5	174.5	1,057	87,382	金融
ENBRIDGE INC	488	571	2,872	237,295	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	220.5	239.5	1,840	152,066	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	529	560	1,463	120,896	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	87	95	356	29,449	ヘルスケア
GOLDCORP INC	233.59	—	—	—	素材
ENCANA CORP	258	368	191	15,840	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	38	39	1,226	101,360	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	29	33	224	18,539	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	56	63	245	20,299	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	192.5	204.5	2,466	203,780	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	69	73	803	66,386	情報技術
HUSKY ENERGY INC	93.58	93.58	90	7,476	エネルギー
ONEX CORPORATION	22	26	205	16,991	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	116	138	378	31,297	コミュニケーション・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	44	—	—	—	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	45	—	—	—	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	19	24	91	7,574	金融
OPEN TEXT CORP	70	81	468	38,701	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	70	146	12,098	金融
SAPUTO INC	63	71	285	23,552	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	177	193	234	19,373	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	116	256	1,112	91,921	生活必需品
FORTIS INC	110	130	676	55,894	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	千カナダ・ドル	千円	
LUNDIN MINING CORP		161	194	139	11,524	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP		133	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		272	314	368	30,456	エネルギー
DOLLARAMA INC		83	90	437	36,130	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		17	22	110	9,159	公益事業
ALTAGAS LTD		69	79	155	12,858	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC		48	48	103	8,558	不動産
KEYERA CORP		53	60	194	16,066	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		104	128	281	23,265	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		97	—	—	—	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	10,989.17 89 銘柄	11,924.58 86 銘柄	55,981	4,625,219 <3.5%>	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD		455	—	—	—	その他
MEDIBANK PRIVATE LTD		728	788	256	19,073	金融
BHP GROUP LTD		847.5	836.5	3,197	237,447	素材
SOUTH32 LTD		1,341	1,516	409	30,392	素材
ALUMINA LTD		623	693	160	11,886	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		245	266.5	919	68,287	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		425	425	413	30,704	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		133	133	133	9,904	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		712.5	794.5	2,056	152,729	金融
WESTPAC BANKING CORP		902.48	973.48	2,386	177,232	金融
SANTOS LTD		452	531	432	32,132	エネルギー
AUSNET SERVICES		500	500	87	6,459	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		770	798.5	1,983	147,272	金融
RIO TINTO LTD		109.5	105	1,017	75,545	素材
ORIGIN ENERGY LTD		462	535	465	34,559	エネルギー
AMCOR LIMITED		314	—	—	—	素材
AURIZON HOLDINGS LTD		543	600	346	25,749	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		—	34	75	5,634	エネルギー
COLES GROUP LTD		297.45	345.45	561	41,706	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		—	45	122	9,114	情報技術
OIL SEARCH LTD		353	384	285	21,212	エネルギー
SEEK LTD		83	96	222	16,529	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		191	205	383	28,463	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		197.5	234	719	53,443	素材
INCITEC PIVOT LTD		423	498	160	11,943	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		462	501.5	4,053	300,944	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD		71.5	71.5	247	18,347	エネルギー
ORICA LTD		101	115	273	20,305	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		360.5	384.5	487	36,200	金融
CIMIC GROUP LTD		24	28	94	6,993	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD		351	362	1,439	106,868	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD		137	137	155	11,576	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD		484	577	276	20,521	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		96	116	149	11,119	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		—	240	175	13,008	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1,105	1,202	463	34,449	コミュニケーション・サービス
AMP LTD		750	1,020	199	14,806	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		120.5	133.5	386	28,706	素材
MACQUARIE GROUP LTD		85.84	91.84	1,267	94,137	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	
ARISTOCRAT LEISURE LTD		152. 5	174. 5	591	43, 948	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD		108	—	—	—	金融
CSL LTD		120. 5	127. 5	3, 614	268, 366	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		297. 45	323	1, 368	101, 614	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		15	16. 5	386	28, 666	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		144	163	237	17, 609	素材
SUNCORP GROUP LTD		343	382. 57	511	38, 006	金融
BORAL LTD		305	358	184	13, 662	素材
ASX LTD		50	58	473	35, 188	金融
COMPUTERSHARE LTD		122. 5	139	246	18, 298	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		140	140	60	4, 469	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		595. 36	709. 36	559	41, 556	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		104	132. 5	399	29, 632	ヘルスケア
CHALLENGER LTD		139	174	141	10, 516	金融
WORLEY LTD		—	94	141	10, 469	エネルギー
AGL ENERGY LTD		174	190	387	28, 793	公益事業
BRAMBLES LTD		415	474	594	44, 169	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		14	14	61	4, 576	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD		38. 5	42. 5	310	23, 029	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD		87	87	60	4, 515	コミュニケーション・サービス
REA GROUP LTD		13. 5	16	166	12, 397	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		—	38	199	14, 810	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		16. 5	—	—	—	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 銘 柄 数 < 比 率 >	18, 651. 08 57 銘柄	20, 170. 2 58 銘柄	37, 167	2, 759, 714 <2. 1%>	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		375	405	2, 205	30, 895	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		650	650	3, 328	46, 625	一般消費財・サービス
MTR CORP		400	455	1, 997	27, 984	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		420	455	5, 182	72, 606	不動産
SINO LAND CO		900	900	1, 056	14, 802	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		706. 69	771. 69	5, 486	76, 868	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD		320	—	—	—	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		125	155	1, 091	15, 298	不動産
CLP HOLDINGS LTD		435	470	3, 792	53, 138	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		359. 16	435. 07	1, 638	22, 948	不動産
HANG LUNG GROUP LTD		210	—	—	—	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		2, 481. 81	2, 901. 99	4, 329	60, 660	公益事業
HANG SENG BANK LTD		204	225	3, 591	50, 309	金融
WHEELOCK & CO LTD		220	240	1, 167	16, 358	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT		1, 590	1, 830	1, 870	26, 202	不動産
WH GROUP LTD		2, 225	2, 950	2, 371	33, 228	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		313	337	8, 330	116, 712	金融
MINTH GROUP LTD		180	—	—	—	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD		1, 520	—	—	—	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		500	570	914	12, 809	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		76	93	950	13, 315	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		190	190	439	6, 162	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD		425	425	446	6, 251	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD		175	175	441	6, 190	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		326. 4	366. 4	647	9, 065	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO		170	—	—	—	不動産
SJM HOLDINGS LTD		470	580	462	6, 484	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	千香港・ドル	千円	
SWIRE PROPERTIES LTD		288	326	793	11,121	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		696.69	741.69	3,860	54,085	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		180	200	1,060	14,850	公益事業
PCCW LTD		1,170	1,170	552	7,736	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD		3,212	3,730	29,243	409,697	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		330	360	1,564	21,914	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD		—	220	662	9,277	生活必需品
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		—	344	959	13,446	生活必需品
SANDS CHINA LTD		644	720	2,664	37,322	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD		300	—	—	—	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		355	410	2,412	33,804	資本財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		236	—	—	—	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		960	1,075	2,859	40,061	金融
WYNN MACAU LTD		420	420	723	10,132	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	24,758.75 39銘柄	25,296.84 34銘柄	99,098	1,388,370 <1.0%>	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD		359	348	898	72,071	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		473	497	1,254	100,657	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		136.7	149.7	137	11,034	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		395	429	288	23,123	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		140	140	108	8,714	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		104	136	140	11,279	不動産
CAPITALAND LTD		689	775	285	22,875	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING		568	693	71	5,725	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		410	514	113	9,070	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		27	27	82	6,635	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		828	937	1,010	81,018	金融
GENTING SINGAPORE LTD		1,530	1,700	157	12,613	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		72	86	136	10,947	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,209.5	2,254.5	762	61,121	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		395	440	181	14,575	資本財・サービス
SEBACORP INDUSTRIES LTD		227	288	63	5,059	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		1,644	—	—	—	生活必需品
SATS LTD		160	196	97	7,829	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		208	233	206	16,539	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD		553	648	152	12,214	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD		492	589	240	19,322	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	11,620.2 21銘柄	11,080.2 20銘柄	6,388	512,429 <0.4%>	
(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		345	345	162	11,477	公益事業
MERCURY NZ LTD		—	230	110	7,797	公益事業
A2 MILK CO LTD		190	214	332	23,458	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD		526.89	526.89	239	16,895	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		234	294	265	18,750	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		201	201	105	7,424	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		151	187	414	29,255	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD		88	118	178	12,584	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,735.89 7銘柄	2,115.89 8銘柄	1,807	127,644 <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	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)						
MERLIN ENTERTAINMENT		193	—	—	—	その他
TUI AG-DI		118.97	137.97	146	20,775	一般消費財・サービス
BP PLC		5,300	5,750	2,761	390,951	エネルギー
UNILEVER PLC		323.1	317.6	1,453	205,868	生活必需品
BARCLAYS PLC		4,500	4,968	852	120,664	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		440	527	375	53,098	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		421	561	109	15,437	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD		24.8	—	—	—	その他
PRUDENTIAL PLC		690	757	1,042	147,538	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		1,267.91	1,457.91	329	46,693	金融
EVRAZ PLC		—	150	55	7,866	素材
JOHNSON MATTHEY PLC		49.64	60.64	174	24,676	素材
BAE SYSTEMS PLC		856	943	540	76,560	資本財・サービス
AVIVA PLC		1,075.66	1,138.66	459	65,101	金融
AVEVA GROUP PLC		—	20	91	12,907	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,309.02	1,410	2,473	350,171	ヘルスケア
INFORMA PLC		320	362	286	40,563	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		115	105.4	119	16,905	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC		1,263	1,455	334	47,300	資本財・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		93	—	—	—	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC		253	283	159	22,519	コミュニケーション・サービス
DCC PLC		26	28	185	26,197	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC		—	135	178	25,326	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		—	21	187	26,537	資本財・サービス
HALMA PLC		—	110	231	32,800	情報技術
GVC HOLDINGS PLC		140	167	142	20,136	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC		330	—	—	—	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC		223	—	—	—	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC		27	27	67	9,591	ヘルスケア
JD SPORTS FASHION PLC		—	130	98	14,000	一般消費財・サービス
M&G PLC		—	757	178	25,295	金融
RELX PLC		528.46	555.46	1,040	147,306	資本財・サービス
DIAGEO PLC		653	675	2,136	302,489	生活必需品
RIO TINTO PLC		314.5	322.5	1,354	191,852	素材
STANDARD CHARTERED PLC		813	821	572	81,069	金融
TESCO PLC		2,548	2,817	646	91,498	生活必需品
FRESNILLO PLC		56	—	—	—	素材
SMITH & NEPHEW PLC		235.5	264.5	457	64,826	ヘルスケア
GLENCORE PLC		3,066.25	3,245.25	791	112,070	素材
JOHN WOOD GROUP PLC		180	—	—	—	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC		74	81.5	151	21,405	金融
SMITHS GROUP PLC		102.33	113.83	189	26,770	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC		61	—	—	—	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		368.83	419.83	128	18,154	金融
PEARSON PLC		201.63	235.63	152	21,572	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC		452.25	542.25	116	16,453	生活必需品
NEXT PLC		35.5	42	283	40,188	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		842	932	162	22,994	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		49.61	38.61	177	25,152	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		88.55	96.05	203	28,872	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		7,021.83	7,661.83	1,175	166,370	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		34.43	36.61	182	25,814	素材

銘柄		期 首		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	
KINGFISHER PLC		554.11	624.11	131	18,548	一般消費財・サービス
WPP PLC		331	384	384	54,397	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		171.27	206.27	176	24,924	公益事業
SEVERN TRENT PLC		63.33	71.33	159	22,653	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		—	540	240	34,016	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		178.5	203	1,231	174,353	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		136	151.5	164	23,349	金融
SCHRODERS PLC		30.5	34.5	113	16,115	金融
SSE PLC		264	300	390	55,220	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE		61.5	79.5	110	15,708	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		259	310	206	29,267	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		334	370.5	2,763	391,239	ヘルスケア
FERGUSON PLC		62.37	70.87	476	67,451	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		1,551	1,830	514	72,783	金融
3I GROUP PLC		253.91	293.91	314	44,569	金融
ASHTED GROUP PLC		127	136.5	320	45,418	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		276.14	323.14	243	34,488	情報技術
NATIONAL GRID PLC		900.34	981.34	873	123,621	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		19,199.65	20,814.65	1,272	180,217	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC		262.6	317.6	175	24,795	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		254	288	490	69,452	生活必需品
CENTRICA PLC		1,526.6	1,761.6	141	20,008	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		32	36	165	23,375	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		605.1	650.1	1,989	281,665	生活必需品
BHP GROUP PLC		565.77	605.27	1,035	146,547	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		91	106	272	38,556	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		5,302.5	5,716.5	3,294	466,456	金融
SHIRE PLC		243.24	—	—	—	その他
ANGLO AMERICAN PLC		328.83	310.83	629	89,187	素材
MONDI PLC		93.5	142.5	238	33,805	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		593	663	131	18,615	生活必需品
CARNIVAL PLC		48.61	48.61	158	22,389	一般消費財・サービス
EASYJET PLC		40	40	53	7,577	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC		422.39	464.89	880	124,703	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		85	93	237	33,683	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		2,224	2,461	471	66,749	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		52	58	149	21,179	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		113.39	121.89	256	36,311	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		46.36	51.36	257	36,411	一般消費財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC		69	—	—	—	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		44	48	264	37,488	資本財・サービス
ITV PLC		931	1,021	148	20,976	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		83.49	91.99	632	89,506	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,217	1,233	2,726	385,997	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		995.68	1,057.18	2,314	327,737	エネルギー
MEGGITT PLC		195	241	154	21,941	資本財・サービス
G4S PLC		378	435	90	12,878	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC		49.5	55.5	118	16,816	金融
INVESTEC PLC		183	—	—	—	金融
ANTOFAGASTA PLC		98	114	98	14,010	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		587.62	708.62	224	31,795	金融
EXPERIAN PLC		240.54	261.54	670	94,911	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株 数、金 額	79,841.11	87,608.13	51,516	7,294,232	
	銘柄 数 < 比 率 >	96 銘柄	93 銘柄		<5.4%>	

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			
(イスラエル)			百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円			
ISRAEL DISCOUNT BANK-A			—	345	548	17,312	金融		
AZRIELI GROUP LTD			10	10	272	8,606	不動産		
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO			483	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
ISRAEL CHEMICALS LTD			176	176	280	8,865	素材		
ELBIT SYSTEMS LTD			6	6	339	10,700	資本財・サービス		
BANK HAPOALIM BM			266	307	848	26,789	金融		
BANK LEUMI LE-ISRAEL			410	452	1,125	35,534	金融		
NICE LTD			16.5	18.5	962	30,360	情報技術		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD			30	41	373	11,775	金融		
イスラエル・シュケル通貨計		株 数、金 額	1,397.5	1,355.5	4,751	149,944			
		銘 柄 数 < 比 率 >	8 銘柄	8 銘柄		<0.1%>			
(スイス)			百株	百株	千スイス・フラン	千円			
DUFREY AG-REG			8.5	12.5	121	13,367	一般消費財・サービス		
UBS GROUP AG-REG			1,022.5	1,104	1,338	146,636	金融		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG			2	2.3	142	15,640	素材		
ADECCO GROUP AG-REG			42.5	46.5	287	31,503	資本財・サービス		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN			185.2	199.4	6,145	673,486	ヘルスケア		
PARGESA HOLDING SA-BR			9.5	11	86	9,511	金融		
SIKA AG-REG			33.6	38.4	668	73,244	素材		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG			0.03	0.03	255	28,044	生活必需品		
ABB LTD-REG			487	538	1,176	128,944	資本財・サービス		
SWISS RE AG			84	90	974	106,817	金融		
NESTLE SA-REG			820	869	9,030	989,668	生活必需品		
PARTNERS GROUP HOLDING AG			4.5	5.2	438	48,051	金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT			10.5	12.6	314	34,424	資本財・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG			671.2	751.7	985	107,957	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD			59	64	301	33,020	金融		
SGS SA-REG			1.4	1.6	416	45,624	資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG			5	5.8	138	15,204	資本財・サービス		
VIFOR PHARMA AG			12	13	231	25,401	ヘルスケア		
TEMENOS AG - REG			15.5	19.7	298	32,750	情報技術		
ALCON INC			—	124.3	686	75,207	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-BR			8.5	8.5	238	26,082	一般消費財・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG			40.22	44.72	1,754	192,260	金融		
BALOISE HOLDING AG - REG			13	13.9	241	26,474	金融		
CLARIANT AG-REG			57	57	117	12,905	素材		
NOVARTIS AG-REG			574	610.5	5,620	615,924	ヘルスケア		
BARRY CALLEBAUT AG-REG			0.6	0.7	140	15,419	生活必需品		
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG			139.6	153.1	1,166	127,782	一般消費財・サービス		
SWISSCOM AG-REG			7.1	7.7	398	43,677	コミュニケーション・サービス		
GEBERIT AG-REG			9.9	11.3	606	66,475	資本財・サービス		
GIVAUDAN-REG			2.5	2.6	764	83,742	素材		
STRAUMANN HOLDING AG-REG			2.7	2.9	278	30,573	ヘルスケア		
SONOVA HOLDING AG-REG			14.2	16.9	385	42,282	ヘルスケア		
LONZA GROUP AG-REG			20.1	22	747	81,876	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-REG			15.2	15.2	81	8,878	一般消費財・サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD-REG			127.9	142.9	736	80,745	素材		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG			9	10.4	515	56,508	金融		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG			14.9	16.7	271	29,758	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			
SWISS PRIME SITE-REG CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		百株 20.3 0.29	百株 23.3 0.34	千スイス・フラン 246 259	千円 26,964 28,411	不動産 生活必需品		
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,550.94 38銘柄	5,069.69 39銘柄	38,609	4,231,250 <3.2%>			
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円			
NOVO NORDISK A/S-B		482	506	19,288	311,898	ヘルスケア		
DANSKE BANK A/S		188	184	1,684	27,241	金融		
ISS A/S		44	44	684	11,074	資本財・サービス		
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.95	0.95	836	13,525	資本財・サービス		
H LUNDBECK A/S		17	17	441	7,141	ヘルスケア		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		52.5	56	3,614	58,442	資本財・サービス		
CARLSBERG AS-B		27.5	30	2,926	47,326	生活必需品		
NOVOZYMES A/S-B SHARES		58	64	2,073	33,530	素材		
COLOPLAST-B		31	33.5	2,684	43,400	ヘルスケア		
DSV PANALPINA A/S		50.1	62.1	4,585	74,146	資本財・サービス		
DEMANT A/S		26.75	34.25	710	11,491	ヘルスケア		
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		1.7	2	1,895	30,651	資本財・サービス		
TRYG A/S		33	33	643	10,405	金融		
PANDORA A/S		27.5	31.5	859	13,905	一般消費財・サービス		
CHR HANSEN HOLDING A/S		25.5	30.5	1,570	25,399	素材		
GENMAB A/S		17	19.5	3,081	49,819	ヘルスケア		
ORSTED A/S		50.5	55	3,437	55,584	公益事業		
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,133 17銘柄	1,203.3 17銘柄	51,019	824,985 <0.6%>			
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円			
NORSK HYDRO ASA		352	417	1,359	16,177	素材		
DNB ASA		261.5	281	4,349	51,763	金融		
ORKLA ASA		208.5	219.5	1,959	23,315	生活必需品		
TELENOR ASA		199	208	3,498	41,632	コミュニケーション・サービス		
EQUINOR ASA		312.23	279.73	4,749	56,522	エネルギー		
YARA INTERNATIONAL ASA		45.6	49.6	1,723	20,510	素材		
MOWI ASA		110.5	128.5	2,937	34,956	生活必需品		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		48.5	55.5	962	11,455	金融		
SCHIBSTED ASA-B SHS		24	31	736	8,765	コミュニケーション・サービス		
AKER BP ASA		29	29	766	9,120	エネルギー		
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,590.83 10銘柄	1,698.83 10銘柄	23,043	274,220 <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			
ICA GRUPPEN AB		19	27	1,128	12,933	生活必需品		
ERICSSON LM-B SHS		811.3	856.3	7,389	84,687	情報技術		
VOLVO AB-B SHS		421	414	6,129	70,241	資本財・サービス		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		18	18	771	8,837	コミュニケーション・サービス		
SKF AB-B SHARES		97.5	105.5	1,929	22,113	資本財・サービス		
ELECTROLUX AB-SER B		59.5	66.5	1,636	18,755	一般消費財・サービス		
SWEDISH MATCH AB		46	49	2,247	25,757	生活必需品		
TELE2 AB-B SHS		137	156	2,204	25,261	コミュニケーション・サービス		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		430.5	482.5	3,962	45,407	金融		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		410.5	465.5	4,375	50,145	金融		
SWEDBANK AB - A SHARES		235	266	3,317	38,013	金融		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		235.5	235.5	4,352	49,885	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	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	
SKANSKA AB-B SHS		91.5	102.5	2,168	24,855	資本財・サービス
SANDVIK AB		298.5	331.5	5,773	66,159	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		123	127	6,428	73,673	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		173.5	184.5	6,474	74,193	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		84.5	95.5	1,516	17,379	資本財・サービス
TELIA CO AB		770	830	3,440	39,426	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		77	88	2,073	23,759	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		103	112.5	3,483	39,915	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		268.5	293.5	6,674	76,486	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS		18	22	835	9,570	金融
LUNDIN PETROLEUM AB		46.5	52.5	1,549	17,760	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		157	168.5	5,071	58,123	生活必需品
BOLIDEN AB		70	78	1,926	22,078	素材
EPIROC AB-A		179.5	206.5	2,308	26,457	資本財・サービス
EPIROC AB-B		97	116	1,248	14,310	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		114.5	114.5	856	9,812	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP		794	897	6,084	69,726	金融
KINNEVIK AB - B		60.5	73	1,600	18,346	金融
HEXAGON AB-B SHS		69	72	3,898	44,671	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		46	46	1,021	11,708	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株 数、金 額	6,562.3	7,152.8	103,879	1,190,454	
	銘柄 数 < 比 率 >	32 銘柄	32 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		60	68	218	26,463	素材
AIB GROUP PLC		230	230	68	8,255	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		274.6	274.6	125	15,133	金融
KINGSPAN GROUP PLC		—	44	215	26,014	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		42.2	45.7	531	64,291	生活必需品
CRH PLC		227	231	802	96,961	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		22	22	228	27,652	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数、金 額	855.8	915.3	2,190	264,773	
	銘柄 数 < 比 率 >	6 銘柄	7 銘柄		<0.2%>	
ユーロ (オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.		59.98	64.98	252	30,518	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		245.26	264.26	1,113	134,604	ヘルスケア
NN GROUP NV		80.5	90.5	315	38,107	金融
UNILEVER NV-CVA		411	—	—	—	その他
HEINEKEN NV		67	76	714	86,379	生活必需品
AEGON NV		447.44	536.44	219	26,530	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		334.83	336.33	786	95,057	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		66	65.38	568	68,682	素材
KONINKLIJKE DSM NV		47.5	53	616	74,496	素材
WOLTERS KLUWER		78	83	540	65,364	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,034.5	1,110.5	1,159	140,174	金融
KONINKLIJKE KPN NV		842.5	1,009.5	282	34,113	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		109	120.6	2,978	360,020	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		110.5	117	181	21,903	金融
ADYEN NV		—	3	208	25,242	情報技術
UNILEVER NV		—	416	2,238	270,494	生活必需品
PROSUS NV		—	145	897	108,425	一般消費財・サービス
VOPAK		19	19	91	11,111	エネルギー

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			
RANDSTAD NV			32	32	169	20,443	資本財・サービス		
HEINEKEN HOLDING NV			31.5	34	295	35,750	生活必需品		
ALTICE EUROPE NV			—	205	110	13,384	コミュニケーション・サービス		
STMICROELECTRONICS NV			185.5	199.5	444	53,768	情報技術		
AIRBUS SE			154.5	165.5	2,207	266,831	資本財・サービス		
EXOR NV			28.8	32.3	224	27,107	金融		
CNH INDUSTRIAL NV			272	298	289	35,036	資本財・サービス		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV			285.5	323.5	434	52,469	一般消費財・サービス		
FERRARI NV			31.45	34.95	536	64,797	一般消費財・サービス		
国	小	計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,974.26 23 銘柄	5,835.24 26 銘柄	17,878	2,160,816 <1.6%>		
			百株	百株	千ユーロ	千円			
ユーロ (ベルギー)									
GALAPAGOS NV			—	13	232	28,100	ヘルスケア		
UCB SA			32.5	35.5	261	31,561	ヘルスケア		
KBC GROUP NV			65	74.5	492	59,552	金融		
COLRUYT SA			16	16	75	9,088	生活必需品		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA			20	22	202	24,488	金融		
SOLVAY SA			19.5	22	228	27,652	素材		
UMICORE			54	58	226	27,324	素材		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV			203.5	216	1,552	187,622	生活必需品		
AGEAS			49.4	52.4	285	34,502	金融		
PROXIMUS			41	41	112	13,567	コミュニケーション・サービス		
TELENET GROUP HOLDING NV			14.5	14.5	59	7,178	コミュニケーション・サービス		
国	小	計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	515.4 10 銘柄	564.9 11 銘柄	3,728	450,639 <0.3%>		
			百株	百株	千ユーロ	千円			
ユーロ (ルクセンブルグ)									
AROUNDTOWN SA			—	271	213	25,815	不動産		
RTL GROUP			10	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
ARCELORMITTAL			177	203	315	38,097	素材		
EUROFINS SCIENTIFIC			2.9	3.2	152	18,432	ヘルスケア		
SES			97	110	132	16,013	コミュニケーション・サービス		
TENARIS SA			120	133	128	15,514	エネルギー		
国	小	計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	406.9 5 銘柄	720.2 5 銘柄	942	113,874 <0.1%>		
			百株	百株	千ユーロ	千円			
ユーロ (フランス)									
JCDECAUX SA			19	19	49	5,970	コミュニケーション・サービス		
TOTAL SA			636.5	679.5	3,237	391,240	エネルギー		
MICHELIN (CGDE)			45	50	544	65,808	一般消費財・サービス		
AIR LIQUIDE SA			112.92	134.77	1,658	200,427	素材		
KERING			19.8	21.8	1,191	144,041	一般消費財・サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE			145	156.5	1,370	165,691	資本財・サービス		
BOUYGUES SA			56	67	248	30,025	資本財・サービス		
BNP PARIBAS			299	320.5	1,633	197,435	金融		
PEUGEOT SA			154.5	175.5	384	46,494	一般消費財・サービス		
NATIXIS			253.5	295.5	112	13,546	金融		
THALES SA			28.5	32.3	287	34,712	資本財・サービス		
DANONE			162	176	1,315	158,939	生活必需品		
CARREFOUR SA			158	170	254	30,778	生活必需品		
SUEZ			99.25	99.25	133	16,115	公益事業		
VIVENDI			279.91	268.91	670	80,991	コミュニケーション・サービス		
L'OREAL			67.3	71.7	1,854	224,180	生活必需品		

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	
		百株	百株	外貨建金額	邦貨換算金額	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		130.5	145.5	534	64,625	資本財・サービス
LEGRAND SA		72.17	80.17	574	69,453	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		15.5	15.5	61	7,482	生活必需品
PERNOD RICARD SA		56.17	60.87	1,014	122,636	生活必需品
SOCIETE BIC SA		7	—	—	—	資本財・サービス
EURAZEO SE		11.95	12.54	77	9,373	金融
REXEL SA		78.5	—	—	—	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA		200.5	220.5	629	76,111	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		73.5	79.3	3,229	390,364	一般消費財・サービス
ACCOR SA		49.5	53.5	207	25,107	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		42.2	47.7	512	61,887	情報技術
VALEO SA		64	71.5	255	30,901	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		56	64	255	30,893	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		71	88	209	25,270	資本財・サービス
EIFFAGE		21.4	23.4	231	28,026	資本財・サービス
SODEXO SA		25	27	285	34,524	一般消費財・サービス
IPSEN		10	11.5	117	14,246	ヘルスケア
INGENICO GROUP		16	18	174	21,071	情報技術
AMUNDI SA		15	17	116	14,115	金融
TELEPERFORMANCE		15	17.7	380	45,993	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		20	24.5	134	16,315	コミュニケーション・サービス
FAURECIA		19	22.5	108	13,090	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		—	8	115	13,932	ヘルスケア
SEB SA		5.6	6.5	91	11,076	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		54.3	83	1,170	141,442	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		0.7	0.8	98	11,940	資本財・サービス
WORLDLINE SA		—	23.64	138	16,785	情報技術
AXA SA		518	553.5	1,366	165,199	金融
EDENRED		64	69	310	37,568	資本財・サービス
RENAULT SA		50	58	252	30,461	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		8.6	9	612	73,966	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		5.5	6.3	73	8,900	生活必需品
ATOS SE		25	29.6	228	27,575	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA		33.8	39.8	569	68,786	情報技術
WENDEL		6.8	7.8	95	11,529	金融
ORANGE		536.5	583	874	105,692	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		40.5	44.5	176	21,287	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		43	48.5	86	10,504	金融
SANOFI		296.75	318.75	2,693	325,567	ヘルスケア
VINCI SA		134.5	145.5	1,440	174,057	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		144.5	164.5	382	46,204	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		301	343	425	51,466	金融
BIOMERIEUX		11.5	11.5	94	11,404	ヘルスケア
ENGIE		478.73	521.23	748	90,462	公益事業
IMERYS SA		9	—	—	—	素材
EDF		159.5	170.5	158	19,213	公益事業
SAFRAN SA		88	93.2	1,383	167,216	資本財・サービス
ILIAD SA		6.5	7.4	85	10,334	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		17.7	19.2	180	21,826	素材
ADP		8.1	9.1	161	19,521	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		47	47	69	8,458	コミュニケーション・サービス
SCOR SE		41.5	49.5	193	23,326	金融
GETLINK SE		124	124	189	22,944	資本財・サービス
BOLLORE		241	241	93	11,301	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	7,107.65 68 銘柄	7,675.23 67 銘柄	38,621	4,667,848 <3.5%>	

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	
ユーロ (ドイツ)						
BAYER AG-REG		246.7	268.2	1,842	222,688	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		42.5	53	139	16,872	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		531.5	593.5	388	46,940	金融
COMMERZBANK AG		263.35	281.35	148	17,889	金融
VOLKSWAGEN AG		8.9	8.9	154	18,624	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		49.7	52.7	924	111,768	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		202	217.5	2,547	307,873	資本財・サービス
E.ON SE		591	642	609	73,696	公益事業
UNIPER SE		53.5	59.5	174	21,070	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		86.5	98.5	722	87,261	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		45	45	131	15,864	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG		25.6	—	—	—	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		29.7	31.7	375	45,438	一般消費財・サービス
BASF SE		244.2	261.7	1,785	215,773	素材
K+S AG-REG		48	—	—	—	素材
ALLIANZ SE-REG		116.3	120.4	2,616	316,277	金融
THYSSENKRUPP AG		114.5	114.5	130	15,748	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		46.5	52	498	60,257	生活必需品
RWE AG		141.5	162.5	437	52,850	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		61	66.5	114	13,840	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		10	11.8	91	11,026	資本財・サービス
BRENNTAG AG		39.5	47	227	27,498	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		112.5	122	605	73,193	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		33.2	33.2	102	12,338	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG		5.3	7.1	79	9,567	資本財・サービス
SAP SE		261.42	279.92	3,456	417,746	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		39.8	41.6	1,084	131,023	金融
SCHAEFFLER AG - PREF		38	—	—	—	一般消費財・サービス
ZALANDO SE		29	35.5	138	16,775	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		39	45	301	36,493	素材
KION GROUP AG		18.5	18.5	111	13,464	資本財・サービス
WIRECARD AG		30.7	34.7	415	50,242	情報技術
COVESTRO AG		52	52	221	26,710	素材
INNOGY SE		37.3	—	—	—	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG		9.5	10.5	200	24,276	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		40	46.5	312	37,755	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		25	32	153	18,564	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		—	12.5	138	16,769	ヘルスケア
METRO AG		50	50	73	8,837	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG		13	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		40	45	198	23,941	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		—	14.5	128	15,470	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		26.9	30.9	327	39,530	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF		17	19.5	76	9,238	素材
MERCK KGAA		34.5	37.5	397	48,041	ヘルスケア
ADIDAS AG		49.3	51.2	1,447	174,966	一般消費財・サービス
PUMA SE		2.06	23.6	160	19,452	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		28.5	31	272	32,895	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		878	959.5	1,461	176,684	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		58.7	62.7	417	50,438	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		238.5	261	1,336	161,507	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		300.5	371.5	720	87,051	情報技術
HANNOVER RUECK SE		16.1	17.3	291	35,231	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	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG			263.5	292	988	119,425	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG			51	56.4	785	94,919	金融
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE			59.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
LANXESS AG			22	25	151	18,280	素材
MTU AERO ENGINES AG			14.3	15.3	376	45,470	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE			12	—	—	—	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE			94	106	375	45,415	不動産
SYMRISE AG			32	39.2	345	41,710	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI			188	263	72	8,807	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF			13.5	15.5	86	10,490	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD			15.9	—	—	—	一般消費財・サービス
VONOVIA SE			132	153	723	87,446	不動産
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,419.43 63 銘柄	6,899.87 57 銘柄	32,595	3,939,443 <2.9%>	
ユーロ (ポルトガル)			百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS			60	60	86	10,511	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA			660	747	274	33,133	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA			116.5	139.5	206	24,910	エネルギー
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	836.5 3 銘柄	946.5 3 銘柄	567	68,555 <0.1%>	
ユーロ (スペイン)			百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA			1,250.27	1,320.27	917	110,931	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA			82.5	92.5	228	27,591	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA			1,748.12	1,910.12	913	110,384	金融
IBERDROLA SA			1,621.34	1,703.34	1,520	183,796	公益事業
BANCO DE SABADELL SA			1,449.09	1,601.09	161	19,486	金融
BANKINTER SA			183	183	116	14,040	金融
REPSOL SA			366.5	418	597	72,192	エネルギー
GRIFOLS SA			77.5	85	263	31,856	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA			4,264.5	4,772.5	1,688	204,015	金融
AMADEUS IT GROUP SA			117	123.5	892	107,916	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA			90.5	94	221	26,811	公益事業
MAPFRE SA			254.5	306.5	78	9,479	金融
CAIXABANK SA			941	1,093	292	35,389	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI			152	—	—	—	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV			67.26	78.76	278	33,630	資本財・サービス
AENA SME SA			18.5	20	333	40,294	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA			—	58	226	27,338	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL			285	323	912	110,320	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE			56	66.5	96	11,641	資本財・サービス
ENAGAS SA			59	69	156	18,855	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA			115	125.5	222	26,923	公益事業
FERROVIAL SA			134	142	382	46,251	資本財・サービス
BANKIA SA			301.05	301.05	52	6,398	金融
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	13,633.63 22 銘柄	14,886.63 22 銘柄	10,553	1,275,547 <1.0%>	
ユーロ (イタリア)			百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA			61.5	68.5	141	17,129	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI			313.43	315.43	584	70,641	金融
MEDIOBANCA SPA			152.65	170.65	173	20,934	金融

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	
UNICREDIT SPA			531.56	576.56	724	87,535	金融
TELECOM ITALIA SPA			2,827.82	2,629.82	149	18,059	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP			1,469.5	1,719.5	96	11,617	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO			3,962.37	4,262.37	980	118,510	金融
ATLANTIA SPA			134.57	146.57	294	35,641	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA			135	160	169	20,478	金融
MONCLER SPA			47	51.5	204	24,754	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA			26	30.5	116	14,033	ヘルスケア
ENI SPA			682	725	994	120,166	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA			143	162	134	16,221	生活必需品
PIRELLI & C SPA			110	110	56	6,846	一般消費財・サービス
LEONARDO SPA			109.75	109.75	116	14,080	資本財・サービス
ENEL SPA			2,154.34	2,307.34	1,581	191,189	公益事業
SNAM SPA			616	616	277	33,591	公益事業
LUXOTTICA GROUP SPA			45	—	—	—	その他
TERNA SPA			389	428	249	30,157	公益事業
FINCOBANK SPA			—	180	202	24,495	金融
国 小 計	株 数、 金 額	13,910.49	14,769.49	7,248	876,085		
	銘 柄 数 < 比 率 >	19 銘柄	19 銘柄		<0.7%>		
			百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)							
UPM-KYMMENE OYJ			137	156	472	57,165	素材
NOKIA OYJ			1,467.5	1,585	509	61,520	情報技術
WARTSILA OYJ ABP			120	120	109	13,250	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS			138	170.5	208	25,140	素材
METSO OYJ			28	28	97	11,776	資本財・サービス
ELISA OYJ			36.5	41.5	201	24,331	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS			116.5	125	458	55,444	金融
FORTUM OYJ			122.5	138.5	296	35,804	公益事業
KONE OYJ-B			88	99	562	67,985	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ			30.5	36.5	89	10,834	一般消費財・サービス
NESTE OYJ			34.5	120.5	369	44,681	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B			27.5	27.5	108	13,128	ヘルスケア
国 小 計	株 数、 金 額	2,346.5	2,648	3,483	421,063		
	銘 柄 数 < 比 率 >	12 銘柄	12 銘柄		<0.3%>		
			百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)							
VERBUND AG			—	20	94	11,404	公益事業
OMV AG			35.5	44.5	230	27,827	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG			74	87	282	34,173	金融
VOESTALPINE AG			28.5	28.5	68	8,284	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA			34	34	72	8,756	金融
ANDRITZ AG			21	21	74	8,984	資本財・サービス
国 小 計	株 数、 金 額	193	235	822	99,430		
	銘 柄 数 < 比 率 >	5 銘柄	6 銘柄		<0.1%>		
ユ ー ロ 通 貨 計	株 数、 金 額	51,199.56	56,096.36	118,633	14,338,077		
	銘 柄 数 < 比 率 >	236 銘柄	235 銘柄		<10.7%>		
フ ァ ン ド 合 計	株 数、 金 額	293,599.53	316,681.1	—	121,306,145		
	銘 柄 数 < 比 率 >	1,242 銘柄	1,252 銘柄		<90.5%>		

(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。

外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期 首 □ 数	当 期 □ 数	期 末 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
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.617	3.867	829	90,938
SIMON PROPERTY GROUP INC	8.137	8.887	1,343	147,388
BOSTON PROPERTIES INC	4	4.25	588	64,579
VORNADO REALTY TRUST	4.347	5.097	329	36,097
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.05	3.15	744	81,698
EQUITY RESIDENTIAL	9.8	10.7	910	99,871
EQUINIX INC	2.088	2.288	1,296	142,249
AMERICAN TOWER CORP	11.45	12.45	2,664	292,261
HOST HOTELS & RESORTS INC	20.043	21.943	383	42,093
KIMCO REALTY CORP	11.1	12.6	272	29,878
INVITATION HOMES INC	8.3	12.7	387	42,526
VICI PROPERTIES INC	—	13.5	333	36,617
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6.279	—	—	—
VENTAS INC	9.15	10.5	612	67,152
WEYERHAEUSER CO	20.064	21.164	624	68,500
AGNC INVESTMENT CORP	12.3	15.3	264	29,064
CROWN CASTLE INTL CORP	10.9	11.75	1,570	172,252
IRON MOUNTAIN INC	6.76	8.21	263	28,923
VEREIT INC	24.4	29.3	285	31,364
SUN COMMUNITIES INC	—	2.75	452	49,679
PROLOGIS INC	16.412	17.812	1,630	178,853
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2.72	3.07	498	54,723
CAMDEN PROPERTY TRUST	2.35	2.9	323	35,480
DUKE REALTY CORP	9.4	10.2	358	39,357
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.7	1.95	608	66,767
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.85	2.2	290	31,867
WELLTOWER INC	9.7	11.45	968	106,206
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12.4	14.35	500	54,897
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.95	4.4	271	29,737
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	3.25	442	48,517
MACERICH CO/THE	2.9	—	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	4.8	355	39,000
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	33.6	43.7	407	44,718
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4.15	4.55	253	27,816
REALTY INCOME CORP	7.55	8.9	682	74,802
PUBLIC STORAGE	4.15	4.37	920	100,979
REGENCY CENTERS CORP	4.05	4.95	321	35,311
SL GREEN REALTY CORP	2.4	2.4	204	22,461
UDR INC	6.8	8.1	389	42,688
WP CAREY INC	4.3	5.1	425	46,662
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	6.4	268	29,503
DIGITAL REALTY TRUST INC	5.5	6.05	731	80,258
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.25	3.75	397	43,618
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	13	269	29,600
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	317.917 39 銘柄	398,058 42 銘柄	25,683 <2.1%>
(カナダ)				
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1.5	2.1	67	5,557
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	2.4	133	10,993
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3.7	3.7	79	6,596
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.9	4.7	127	10,538
カ ナ ダ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	9.1 3 銘柄	12.9 4 銘柄	407 <0.0%>

銘柄		期首	当	期末	
		口数	口数	評価額	金額
		千口	千口	外貨建金額 千オーストラリア・ドル	邦貨換算金額 千円
(オーストラリア)					
LENLEASE GROUP		14.9	17	328	24,374
TRANSURBAN GROUP		68.1	76.5	1,174	87,189
SYDNEY AIRPORT		30.3	33.3	305	22,697
APA GROUP		31.2	35.8	393	29,239
SCENTRE GROUP		143.322	153.922	606	45,029
DEXUS		25.85	33.15	405	30,102
GPT GROUP		47.56	56.16	345	25,644
MIRVAC GROUP		98.8	111.6	376	27,924
STOCKLAND		66	72	363	26,997
GOODMAN GROUP		43.9	50.1	742	55,129
VICINITY CENTRES		89.273	99.273	266	19,754
オーストラリア・ドル通貨計	口数 銘柄数 < 金比率 >	659.205 11銘柄	738.805 11銘柄	5,307	394,083 <0.3%>
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT		57	62.5	5,000	70,050
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		64.5	75	575	8,059
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		99	107	1,228	17,209
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	口数 銘柄数 < 金比率 >	220.5 3銘柄	244.5 3銘柄	6,803	95,318 <0.1%>
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		70.1	79.6	159	12,833
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		69.5	76	226	18,165
CAPITALAND MALL TRUST		63.2	77.2	194	15,604
SUNTEC REIT		63	63	115	9,297
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	65.5	154	12,398
シンガポール・ドル通貨計	口数 銘柄数 < 金比率 >	265.8 4銘柄	361.3 5銘柄	851	68,300 <0.1%>
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		19.662	21.662	207	29,395
SEGRO PLC		25.75	33.15	296	41,961
HAMMERSON PLC		19.2	—	—	—
BRITISH LAND CO PLC		23.4	25.55	147	20,823
イギリス・ポンド通貨計	口数 銘柄数 < 金比率 >	88.012 4銘柄	80.362 3銘柄	651	92,180 <0.1%>
ユーロ (フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3.61	3.95	560	67,742
ICADE		0.8	0.95	86	10,431
GECINA SA		1.25	1.4	219	26,531
KLEPIERRE		5.65	6.25	203	24,602
COVIVIO		0.97	1.27	127	15,410
ユ ー ロ 通 貨 計	口数 銘柄数 < 金比率 >	12.28 5銘柄	13.82 5銘柄	1,197	144,718 <0.1%>
合 計	口数 銘柄数 < 金比率 >	1,572.814 69銘柄	1,849.745 73銘柄	—	3,645,255 <2.7%>

(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。

外国株式インデックスマザーファンド

(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 (アメリカ)	百万円 6,654	百万円 —
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	336	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	190	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	479	—
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	264	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	993	—

(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

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	121,306,145	90.5
投資信託証券	3,645,255	2.7
コール・ローン等、その他	9,152,768	6.8
投資信託財産総額	134,104,169	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.68円、1カナダ・ドル＝82.62円、1オーストラリア・ドル＝74.25円、1香港・ドル＝14.01円、1シンガポール・ドル＝80.21円、1ニュージーランド・ドル＝70.63円、1イギリス・ポンド＝141.59円、1イスラエル・シェケル＝31.56円、1スイス・フラン＝109.59円、1デンマーク・クローネ＝16.17円、1ノルウェー・クローネ＝11.90円、1スウェーデン・クローネ＝11.46円、1ユーロ＝120.86円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（127,572,094千円）の投資信託財産総額（134,104,169千円）に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	140,417,534,982円
コール・ローン等	6,979,983,687
株式（評価額）	121,306,145,522
投資信託証券（評価額）	3,645,255,546
未収入金	6,783,395,334
未収配当金	214,896,369
差入委託証拠金	1,487,858,524
(B) 負債	6,448,920,207
未払金	6,390,634,815
未払解約金	58,281,600
その他未払費用	3,792
(C) 純資産総額（A－B）	133,968,614,775
元本	48,893,612,273
次期繰越損益金	85,075,002,502
(D) 受益権総口数	48,893,612,273口
1万口当り基準価額（C／D）	27,400円

* 期首における元本額は43,964,024,902円、当作成期間中における追加設定元本額は10,527,862,672円、同解約元本額は5,598,275,301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は、ダイワ外国株式インデックスV A466,203,951円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）12,135,579円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）136,414,008円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）19,175,184円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）467,869,193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）8,549,100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）538,132,530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）1,863,069,978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）538,513,489円、D－I's 外国株式インデックス2,768,783円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 2,115,496円、iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）1,146,595,215円、iFree 8資産バランス816,785,041円、iFree 年金バランス26,201,082円、DCダイワ外国株式インデックス29,501,748,908円、ダイワ・ライフ・バランス30 576,429,097円、ダイワ・ライフ・バランス50 874,085,645円、ダイワ・ライフ・バランス70 675,316,597円、大和DC海外株式インデックスファンド1,500,453,033円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,017,912円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 14,368,992円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 5,760,550円、ダイワつみたてインデックス外国株式136,727,006円、ダイワつみたてインデックスバランス30 88,638円、ダイワつみたてインデックスバランス50 86,527円、ダイワつみたてインデックスバランス70 530,015円、ダイワ世界バランスファンド40VA184,271,979円、ダイワ世界バランスファンド60VA323,611,524円、ダイワ・バランスファンド35VA2,650,169,104円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）127,631,309円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式677,239,222円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド111,772,535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）2,632,754,719円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,712,848,524円、ダイワライフスタイル25 18,663,687円、ダイワライフスタイル50 67,445,810円、ダイワライフスタイル75 54,062,311円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,400円です。

■損益の状況

当期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2, 549, 233, 818円
受取配当金	2, 536, 822, 509
受取利息	2, 018, 549
その他収益金	11, 188, 012
支払利息	△ 795, 252
(B) 有価証券売買損益	10, 836, 018, 993
売買益	18, 159, 378, 903
売買損	△ 7, 323, 359, 910
(C) 先物取引等損益	573, 606, 102
取引益	720, 048, 944
取引損	△ 146, 442, 842
(D) その他費用	△ 33, 986, 973
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	13, 924, 871, 940
(F) 前期繰越損益金	63, 729, 500, 967
(G) 解約差損益金	△ 8, 614, 819, 683
(H) 追加信託差損益金	16, 035, 449, 278
(I) 合計 (E + F + G + H)	85, 075, 002, 502
次期繰越損益金 (I)	85, 075, 002, 502

(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。