

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（2006年5月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、日本を除く世界の主要国の株式に投資することにより、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）と連動する投資成果をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビード ファンド	外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。
	マザー ファンド	MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビード ファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザー ファンド	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ DC海外株式インデックス ファンド

第10期（決算日：2016年5月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド」は、去る5月12日に第10期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目 12 番 1 号
URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

三菱UFJ DC海外株式インデックスファンドのご報告

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	6
◇1万口当たりの費用明細	7
◇売買及び取引の状況	8
◇株式売買比率	8
◇利害関係人との取引状況等	8
◇組入資産の明細	9
◇投資信託財産の構成	9
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	10
◇損益の状況	10
◇お知らせ	11

マザーファンドのご報告

◇外国株式インデックスマザーファンド	12
--------------------	----

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産 総額		
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰					中 落	率
	円	円	円	円	円	%	%	%	百万円		
6期(2012年5月14日)	7,691		0		△7.0	74.99	△9.3	95.2	2.6	2.0	1,390
7期(2013年5月13日)	12,014		0		56.2	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	2,536
8期(2014年5月12日)	14,024		0		16.7	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	3,852
9期(2015年5月12日)	17,753		0		26.6	162.29	24.2	96.4	1.2	2.2	8,885
10期(2016年5月12日)	15,149		0		△14.7	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	11,542

- (注) MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index (米ドルベース)をもとに委託会社が計算したものです。また、MSCI Kokusai Indexに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- (注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
- (注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		M S C I K o k u s a i I n d e x (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2015年5月12日	17,753	—	162.29	—	96.4	1.2	2.2
5月末	18,355	3.4	167.17	3.0	94.8	1.2	2.2
6月末	17,624	△ 0.7	160.34	△ 1.2	96.0	1.8	2.2
7月末	18,115	2.0	164.73	1.5	98.2	1.1	2.3
8月末	16,674	△ 6.1	151.30	△ 6.8	94.5	3.0	2.4
9月末	15,532	△12.5	140.71	△13.3	95.3	2.3	2.5
10月末	17,225	△ 3.0	155.86	△ 4.0	95.1	1.4	2.5
11月末	17,410	△ 1.9	157.46	△ 3.0	94.8	5.3	2.4
12月末	16,998	△ 4.3	153.40	△ 5.5	94.3	3.8	2.5
2016年1月末	15,487	△12.8	139.74	△13.9	95.2	2.3	2.6
2月末	14,843	△16.4	133.62	△17.7	95.3	2.1	2.6
3月末	15,699	△11.6	141.17	△13.0	99.9	2.3	2.8
4月末	15,624	△12.0	140.05	△13.7	94.9	3.0	2.6
(期 末) 2016年5月12日	15,149	△14.7	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第10期：2015/5/13～2016/5/12)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ14.7%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-16.4%）を1.7%上回りました。



基準価額の主な変動要因

下落要因

- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから外国株式市況が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。さらに、米ドルやユーロが円に対して下落したことも基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第10期：2015/5/13～2016/5/12)

◎外国株式市況

- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて9.8%の円高・米ドル安、7.5%の円高・ユーロ安となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド＞

- ・当ファンドは、主として、外国株式インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）に投資しており、これを通じてベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・資産のほぼ全額をマザーファンドに投資することで、株式（先物・REIT（不動産投資信託証券）を含む）の実質組入比率は高水準を維持しました。このため基準価額は、外国株式市況とほぼ同様の推移となりました。

＜外国株式インデックスマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ14.5%の下落となりました。

- ・MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）に採用されている株式（先物・REITを含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

当該投資信託のベンチマークとの差異について

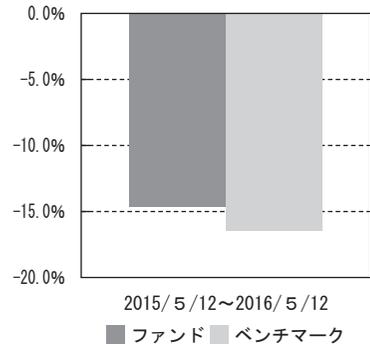
＜三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド＞
ベンチマークとのカイ離は1.7%程度となりました。

	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.2%程度	1.9%程度	1.7%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

- ◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。
- ◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は1.9%程度でした。

基準価額（ベビーファンド）と
ベンチマークの対比（騰落率）



＜外国株式インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは16.4%の下落となったため、カイ離は1.9%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	1.9%程度	1.9%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

- ◎組入比率要因
組入比率による影響は△0.0%程度でした。
・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・REITを含む）に投資しました。
・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。
- ◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。
ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、
・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計	2.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計	△0.1%程度

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。
 ファンド：株価（現地通貨建て前日終値）を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。
 ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートをを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第10期
	2015年5月13日～2016年5月12日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	11,182

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

<三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド>

- ・ファンド資産のほぼ全額を外国株式インデックスマザーファンド受益証券に投資し、株式の実質組入比率は高水準を維持します。

<外国株式インデックスマザーファンド>

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・REITを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	38	0.227	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
（ 投 信 会 社 ）	(12)	(0.070)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(16)	(0.097)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(10)	(0.059)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	3	0.016	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	(2)	(0.011)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(1)	(0.004)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	6	0.036	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(6)	(0.035)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	9	0.051	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(8)	(0.051)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	56	0.330	
期中の平均基準価額は、16,632円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
外国株式インデックスマザーファンド	2,238,801 千口	4,919,914 千円	240,470 千口	514,744 千円

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	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	233,432,694千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	224,041,096千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.04	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド>

該当事項はございません。

<外国株式インデックスマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			B/A			D/C
為替直物取引	百万円 192,818	百万円 3,670	% 1.9	百万円 114,849	百万円 7,344	% 6.4

平均保有割合 4.6%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国株式インデックスマザーファンド	千口 3,852,279	千口 5,850,610	千円 11,540,914

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国株式インデックスマザーファンド	千円 11,540,914	% 99.7
コール・ローン等、その他	37,959	0.3
投資信託財産総額	11,578,873	100.0

(注) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (269,579,000千円) の投資信託財産総額 (270,164,641千円) に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 ユーロ=123.81円	1 イギリスポンド=156.52円
1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=79.91円	1 ニュージーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円
1 イスラエルシェケル=28.84円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	11,578,873,301
コール・ローン等	35,134,141
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	11,540,914,560
未収入金	2,824,600
(B) 負債	36,404,480
未払解約金	23,706,435
未払信託報酬	12,697,950
未払利息	71
その他未払費用	24
(C) 純資産総額(A-B)	11,542,468,821
元本	7,619,083,772
次期繰越損益金	3,923,385,049
(D) 受益権総口数	7,619,083,772口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,149円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,005,192,243円
 期中追加設定元本額 3,938,398,553円
 期中一部解約元本額 1,324,507,024円
 また、1口当たり純資産額は、期末15,149円です。

②分配金の計算過程

項 目	2015年5月13日～ 2016年5月12日
費用控除後の配当等収益額	228,747,324円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円
収益調整金額	6,605,666,097円
分配準備積立金額	1,685,799,606円
当ファンドの分配対象収益額	8,520,213,027円
1万口当たり収益分配対象額	11,182円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	13,410
受取利息	15,136
支払利息	△ 1,726
(B) 有価証券売買損益	△1,619,628,542
売買益	133,873,500
売買損	△1,753,502,042
(C) 信託報酬等	△ 24,309,792
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,643,924,924
(E) 前期繰越損益金	1,685,799,606
(F) 追加信託差損益金	3,881,510,367
(配当等相当額)	(6,596,781,780)
(売買損益相当額)	(△2,715,271,413)
(G) 計(D+E+F)	3,923,385,049
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	3,923,385,049
追加信託差損益金	3,881,510,367
(配当等相当額)	(6,605,666,097)
(売買損益相当額)	(△2,724,155,730)
分配準備積立金	1,914,546,930
繰越損益金	△1,872,672,248

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)

外国株式インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	(円換算ベース)	(米ドルベース)				
	円	%		%	%	%	%	百万円
11期(2012年5月14日)	9,921	△ 6.8	74.99	△ 9.3	95.2	2.6	2.0	142,226
12期(2013年5月13日)	15,535	56.6	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	199,188
13期(2014年5月12日)	18,176	17.0	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	197,280
14期(2015年5月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年5月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065

(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円換算ベース) は、MSCI Kokusai Index (米ドルベース) をもとに委託会社が計算したものです。また、MSCI Kokusai Index に対する著作権及びその他の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2015年5月12日	23,063	—	162.29	—	96.5	1.2	2.2
5月末	23,848	3.4	167.17	3.0	94.8	1.2	2.2
6月末	22,902	△ 0.7	160.34	△ 1.2	96.0	1.8	2.2
7月末	23,546	2.1	164.73	1.5	98.2	1.1	2.3
8月末	21,677	△ 6.0	151.30	△ 6.8	94.5	3.0	2.4
9月末	20,196	△12.4	140.71	△13.3	95.4	2.3	2.5
10月末	22,402	△ 2.9	155.86	△ 4.0	95.1	1.4	2.5
11月末	22,647	△ 1.8	157.46	△ 3.0	94.8	5.3	2.4
12月末	22,114	△ 4.1	153.40	△ 5.5	94.3	3.8	2.5
2016年1月末	20,152	△12.6	139.74	△13.9	95.2	2.3	2.6
2月末	19,318	△16.2	133.62	△17.7	95.4	2.1	2.6
3月末	20,436	△11.4	141.17	△13.0	99.9	2.3	2.8
4月末	20,342	△11.8	140.05	△13.7	94.9	3.0	2.6
(期 末) 2016年5月12日	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

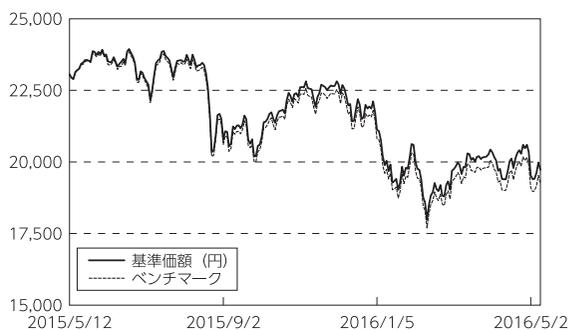
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−16.4%)を1.9%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて9.8%の円高・米ドル安、7.5%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス) (円換算ベース) に採用されている株式 (先物・REIT (不動産投資信託証券) を含む) を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造 (動向) を、複数の要因 (業種・通貨・企業規模など) に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは16.4%の下落となったため、カイ離は1.9%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	Δ0.0%程度	Δ0.0%程度	1.9%程度	1.9%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響はΔ0.0%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式 (先物・REITを含む) に投資しました。
- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響はΔ0.0%程度でした。

ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、

- ・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
- ・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計 2.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計 Δ0.1%程度

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。

ファンド：株価 (現地通貨建て前日終値) を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

ベンチマーク：株価 (現地通貨建て前日終値) を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートをを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式 (先物・REITを含む) に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(2)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	8	0.036	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(8)	(0.036)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.051	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(11)	(0.051)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	22	0.103	
期中の平均基準価額は、21,631円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 37,928 (4,668)	千オーストラリアドル 50,029 (247)	百株 18,319 (412)	千オーストラリアドル 23,475 (370)
	ニュージーランド	2,729	千ニュージーランドドル 1,167	831	千ニュージーランドドル 317
	香港	44,149 (2,980)	千香港ドル 127,962 (-)	20,283 (1,270)	千香港ドル 64,359 (-)
	シンガポール	24,000 (7)	千シンガポールドドル 9,166 (-)	10,988	千シンガポールドドル 4,495
	イスラエル	2,648	千イスラエルシケル 14,127	1,044	千イスラエルシケル 6,150

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	21	759	10	387
MACERICH CO/THE	6	514	3	302
PROLOGIS INC	24	1,006	10	455
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	315	1	155
DIGITAL REALTY TRUST INC	7	589	3	261
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	691	1	321
EXTRA SPACE STORAGE INC	11	918	2	191
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	467	1	213
WELLTOWER INC	16	1,096	7	532
BOSTON PROPERTIES INC	6	854	3	414
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	595	0.2	20
REALTY INCOME CORP	12	682	5	262
REGENCY CENTERS CORP	4	288	1	130
SL GREEN REALTY CORP	4	490	2	246
UDR INC	12	445	5	209
VENTAS INC	15	893	6	412
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	46	465	24	242
RAYONIER INC	—	—	7	193
WEYERHAEUSER CO	28 (18)	838 (484)	12	387
AMERICAN TOWER CORP	19	1,866	9	895
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	14	270	7	133
VEREIT INC	38	321	17	147
DUKE REALTY CORP	15	315	6	143
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17	443	2	58
IRON MOUNTAIN INC	11	346	3	103
EQUINIX INC	2 (0.089)	880 (26)	0.763	226
COMMUNICATIONS SALES & LE	1	23	8	164
CROWN CASTLE INTL CORP	13 (20)	1,183 (1,658)	6	547
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (4)	— (—)	4	143
EQUITY RESIDENTIAL	17	1,285	7	562
GENERAL GROWTH PROPERTIES	28	773	11	323
HOST HOTELS & RESORTS INC	33	554	16	280
LIBERTY PROPERTY TRUST	6	195	2	91
PLUM CREEK TIMBER CO	4 (△ 11)	187 (△ 484)	3	153
PUBLIC STORAGE	6	1,589	3	717
SIMON PROPERTY GROUP INC	13	2,670	6	1,264
VORNADO REALTY TRUST	7	697	3	325
KIMCO REALTY CORP	18	488	8	221

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,127	2	511
小 計	513 (31)	27,136 (1,685)	245	12,357
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	6	195	0.9	27
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	147	4	83
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7	192	3	87
小 計	20	536	8	199
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	1	217	0.714	84
KLEPIERRE	13	543	5	220
UNIBAIL-RODAMCO SE	4	1,067	2	514
FONCIERE DES REGIONS	1	116	0.709	56
ICADE	1	110	1	73
小 計	22	2,056	10	948
ユ ー ロ 計	22	2,056	10	948
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	44	338	20	165
HAMMERSON PLC	36	219	18	113
LAND SECURITIES GROUP PLC	36	429	18	224
INTU PROPERTIES PLC	42	134	18	59
SEGRO PLC	32	137	14	62
小 計	192	1,259	90	625
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	164	486	73	213
SCENTRE GROUP	246	1,037	115	480
FEDERATION CENTRES	— (103)	— (316)	—	—
NOVION PROPERTY GROUP	— (△ 126)	— (△ 316)	6	16
GPT GROUP	92	440	41	196
MIRVAC GROUP	166	307	74	144
STOCKLAND	113	464	53	223
WESTFIELD CORP	90	897	43	420
DEXUS PROPERTY GROUP	44	334	17	135
GOODMAN GROUP	88	564	43	283
小 計	1,007 (△ 22)	4,533 (—)	470	2,113
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	106	4,778	55	2,497
小 計	106	4,778	55	2,497
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
SUNTEC REIT	113 (—)	181 (△ 1)	44	68

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	89	126	47	68
	CAPITALAND MALL TRUST	93	193	24	46
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	77 (-)	184 (△0.24159)	15	35
	小計	373 (-)	684 (△ 1)	131	218

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 141,684	百万円 135,556	百万円 -	百万円 -

(注) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	233,432,694千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	224,041,096千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.04

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	%
為替直物取引	百万円 3,670	1.9	%	百万円 7,344	6.4	%
	百万円 192,818			百万円 114,849		

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC	698	1,083	1,033	112,050	素材
AMERICAN EXPRESS CO	551	692	4,470	484,457	各種金融
AVON PRODUCTS INC	252	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	892	1,233	4,688	508,145	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	198	274	1,165	126,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	33	44	740	80,239	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	285	381	3,306	358,302	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	42	58	276	29,970	小売
AES CORP	404	566	641	69,479	公益事業
AFLAC INC	266	352	2,422	262,531	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	829	1,022	5,723	620,234	保険
APACHE CORP	222	313	1,692	183,470	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	37	50	1,039	112,614	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	371	516	5,993	649,553	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	126	169	2,410	261,252	素材
ANTHEM INC	159	215	3,013	326,522	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	300	421	2,018	218,738	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	785	1,112	2,455	266,066	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	320	472	2,190	237,343	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	401	526	7,003	758,941	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	123	174	2,913	315,756	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	177	256	807	87,510	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	983	1,380	9,774	1,059,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	78	101	3,595	389,684	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,459	3,367	17,223	1,866,514	電気通信サービス
CR BARD INC	44	61	1,340	145,257	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	77	108	784	84,995	素材
BAKER HUGHES INC	256	361	1,618	175,449	エネルギー
ALLSTATE CORP	248	319	2,154	233,434	保険
VERY DENNISON CORP	53	75	570	61,797	素材
CHUBB LTD	196	380	4,713	510,750	保険
ANALOG DEVICES INC	185	258	1,438	155,922	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	18	25	1,943	210,587	小売
CVS HEALTH CORP	679	916	9,541	1,033,975	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	136	178	965	104,598	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	758	978	1,846	200,089	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	2,216	3,045	18,822	2,039,781	銀行
CIGNA CORP	154	212	2,779	301,225	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	340	481	3,490	378,215	資本財
COCA-COLA CO/THE	2,337	3,417	15,535	1,683,562	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	329	440	3,095	335,463	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	121	153	1,005	108,926	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	590	807	2,090	226,506	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	118	166	576	62,437	メディア
CHEVRON CORP	1,120	1,557	15,753	1,707,213	エネルギー
COACH INC	163	229	876	94,977	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROCKWELL COLLINS INC	70	108	983	106,593	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	83	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	729	1,022	4,465	483,916	エネルギー
CME GROUP INC	189	265	2,483	269,182	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	195	271	2,093	226,827	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	540	705	5,075	550,003	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	347	495	3,554	385,171	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	698	930	4,766	516,524	素材
DEVON ENERGY CORP	230	381	1,240	134,378	エネルギー
DEERE & CO	201	258	2,167	234,898	資本財
DANAHER CORP	374	509	4,993	541,125	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	536	724	4,662	505,265	素材
WALT DISNEY CO/THE	954	1,299	13,288	1,440,107	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	79	94	599	64,955	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	420	571	4,601	498,711	公益事業
DR HORTON INC	194	280	815	88,376	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	57	74	311	33,776	小売
TARGET CORP	358	483	3,662	396,857	小売
DUN & BRADSTREET CORP	21	29	351	38,088	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	39	—	—	—	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	101	140	1,069	115,857	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	98	128	847	91,835	資本財
DTE ENERGY COMPANY	105	150	1,366	148,099	公益事業
EXXON MOBIL CORP	2,510	3,444	30,592	3,315,344	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	63	178	1,874	203,176	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	324	455	3,657	396,349	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	410	541	2,860	310,017	資本財
EXELON CORP	510	763	2,698	292,443	公益事業
ECOLAB INC	159	219	2,564	277,893	素材
EQUIFAX INC	71	98	1,197	129,784	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	138	—	—	—	エネルギー
EMC CORP/MA	1,205	1,603	4,352	471,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	137	183	1,745	189,167	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	280	382	2,372	257,153	資本財
EDISON INTERNATIONAL	184	271	1,956	212,057	公益事業
ENTERGY CORP	107	149	1,148	124,409	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	26	35	643	69,746	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	36	49	389	42,176	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	259	382	4,580	496,353	公益事業
MACY'S INC	204	260	815	88,416	小売
FEDEX CORP	159	222	3,581	388,156	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	137	189	532	57,653	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	60	—	—	—	小売
FORD MOTOR CO	2,127	3,065	4,083	442,505	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	238	322	1,149	124,556	各種金融
FOOT LOCKER INC	84	114	675	73,229	小売
FIRSTENERGY CORP	250	353	1,201	130,201	公益事業
FLUOR CORP	92	117	604	65,513	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	614	957	1,111	120,433	素材
GENERAL MILLS INC	357	494	3,163	342,787	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	166	222	3,218	348,841	資本財
WW GRAINGER INC	36	46	1,079	116,971	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	5,953	7,808	23,691	2,567,458	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	—	111	825	89,460	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	90	124	1,196	129,633	小売
TEGNA INC	—	174	404	43,791	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	222	622	67,415	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	143	200	371	40,296	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	232	317	5,064	548,817	各種金融
HALLIBURTON CO	502	708	2,802	303,682	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	440	605	6,908	748,656	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	126	159	727	78,787	自動車・自動車部品
HP INC	1,106	1,487	1,739	188,493	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	254	338	1,497	162,230	保険
HERSHEY CO/THE	90	122	1,131	122,611	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	282	—	—	—	メディア
HOSPIRA INC	100	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARMAN INTERNATIONAL	—	58	435	47,178	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	781	1,048	14,086	1,526,520	小売
HASBRO INC	66	92	784	84,997	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	157	215	1,423	154,273	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	557	762	11,358	1,230,870	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	237	325	1,394	151,162	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	219	270	2,822	305,834	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	246	336	798	86,515	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	48	66	821	88,980	素材
JOHNSON & JOHNSON	1,659	2,288	26,179	2,837,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	394	535	2,196	238,038	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	66	90	830	90,013	運輸
KELLOGG CO	157	219	1,674	181,466	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	221	300	3,869	419,285	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	995	1,314	5,836	632,483	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	276	765	2,655	287,779	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	121	160	622	67,429	小売
ELI LILLY & CO	593	825	6,296	682,334	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	59	83	1,062	115,102	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	101	137	578	62,701	運輸
LENNAR CORP-A	101	148	654	70,963	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	584	758	5,699	617,607	小売
LEGGETT & PLATT INC	81	112	553	60,026	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	147	204	1,378	149,355	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	237	329	1,496	162,140	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	159	228	5,536	599,959	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	154	204	879	95,263	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	50	64	880	95,420	資本財
LEGG MASON INC	61	82	252	27,387	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	134	170	1,172	127,112	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	576	759	9,806	1,062,772	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	160	223	2,354	255,157	各種金融
MEDTRONIC PLC	839	1,169	9,482	1,027,617	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	1,690	2,310	12,550	1,360,132	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	635	899	908	98,413	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	202	280	867	94,056	耐久消費財・アパレル
3M CO	360	509	8,645	936,880	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	133	132	925	100,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	234	373	822	89,154	消費者サービス
MASCO CORP	209	279	883	95,704	資本財
MONSANTO CO	286	363	3,287	356,273	素材
MEADWESTVACO CORP	97	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	70	118	1,373	148,810	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	320	431	2,757	298,813	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	37	52	1,023	110,869	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	869	1,201	3,168	343,361	各種金融
MCKESSON CORP	137	190	3,215	348,445	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	571	781	3,392	367,601	保険
MANPOWERGROUP INC	47	60	470	50,940	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	111	147	1,400	151,806	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	183	247	2,196	238,007	運輸
BANK OF AMERICA CORP	6,233	8,614	12,232	1,325,653	銀行
NISOURCE INC	188	—	—	—	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	113	143	3,070	332,756	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	265	402	599	64,974	銀行
NEWMONT MINING CORP	292	437	1,482	160,664	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	804	966	2,841	307,972	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	69	96	936	101,529	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	—	11	1,101	119,338	保険
NUCOR CORP	189	264	1,258	136,427	素材
NEWELL BRANDS INC	160	367	1,777	192,661	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	149	—	—	—	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	259	366	1,083	117,424	メディア
NOBLE ENERGY INC	229	355	1,294	140,241	エネルギー
PALL CORP	62	—	—	—	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	461	632	4,825	522,935	エネルギー
OMNICARE INC	57	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	146	200	1,685	182,658	メディア
PEPSICO INC	887	1,205	12,741	1,380,805	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	80	531	57,587	素材
ALTRIA GROUP INC	1,171	1,622	10,481	1,135,913	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	66	94	694	75,293	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,602	2,249	18,482	2,002,994	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	311	419	3,624	392,774	銀行
PFIZER INC	3,735	5,106	16,934	1,835,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	269	371	2,828	306,536	保険
PULTEGROUP INC	196	260	471	51,145	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS LLC	151	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	88	112	1,269	137,606	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	88	133	2,196	238,037	エネルギー
CITIGROUP INC	1,795	2,465	10,962	1,188,003	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	174	242	1,029	111,524	保険
PPG INDUSTRIES INC	81	222	2,392	259,328	素材
PENTAIR PLC	111	149	880	95,381	資本財
PRAXAIR INC	172	235	2,674	289,793	素材
P G & E CORP	282	408	2,418	262,121	公益事業
PPL CORP	396	560	2,171	235,301	公益事業
PROGRESSIVE CORP	330	482	1,600	173,472	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	301	421	1,955	211,904	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	106	145	1,184	128,389	消費者サービス
SPX CORP	20	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	98	145	1,093	118,529	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	182	248	3,253	352,542	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	168	200	976	105,789	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	819	1,078	993	107,714	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	27	36	409	44,324	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	59	83	1,468	159,157	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	245	345	760	82,464	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	80	109	428	46,487	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	80	109	1,244	134,837	資本財
SCHLUMBERGER LTD	763	1,152	8,503	921,476	エネルギー
STRYKER CORP	201	279	3,118	337,920	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	695	980	2,724	295,218	各種金融
SEMPRA ENERGY	139	196	2,074	224,784	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	48	65	1,926	208,815	素材
ST JUDE MEDICAL INC	169	234	1,770	191,913	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	88	123	1,398	151,550	資本財
SUNTRUST BANKS INC	308	420	1,741	188,676	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	196	251	2,812	304,762	保険
SOUTHERN CO/THE	535	755	3,802	412,031	公益事業
AT&T INC	3,074	5,089	19,939	2,160,846	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	130	189	697	75,608	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	246	333	2,013	218,189	各種金融
SYSCO CORP	347	466	2,343	254,015	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	119	163	764	82,871	素材
SCANA CORP	81	114	802	86,918	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	92	—	—	—	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	625	839	4,835	524,029	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	77	106	704	76,367	小売
TORCHMARK CORP	74	101	596	64,660	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	248	349	1,344	145,752	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	237	330	4,886	529,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	164	226	864	93,683	資本財
UNION PACIFIC CORP	527	706	5,972	647,213	運輸
UNUM GROUP	150	201	679	73,679	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	513	696	7,081	767,413	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	569	788	10,303	1,116,544	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,060	1,446	6,054	656,133	銀行
MARATHON OIL CORP	399	682	849	92,105	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	416	576	5,907	640,170	運輸
VALERO ENERGY CORP	308	398	2,226	241,289	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	59	80	656	71,109	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	284	359	2,003	217,094	メディア
VF CORP	204	282	1,711	185,514	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	78	110	1,271	137,799	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	41	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	420	590	1,151	124,749	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	516	720	5,780	626,484	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	136	264	1,589	172,220	公益事業
WAL-MART STORES INC	955	1,325	8,803	954,086	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	2,921	4,013	19,700	2,134,939	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	257	369	2,263	245,315	商業・専門サービス
WATERS CORP	49	67	910	98,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	461	731	410	44,453	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	46	64	1,115	120,913	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	636	754	700	75,954	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	178	244	825	89,427	保険
XCEL ENERGY INC	301	424	1,757	190,495	公益事業
KEYCORP	511	684	818	88,732	銀行
CARMAX INC	127	168	856	92,857	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	100	156	1,827	198,084	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	101	139	369	40,046	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	259	356	2,878	311,964	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	410	553	4,097	444,060	小売
CA INC	196	271	814	88,227	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	116	—	—	—	エネルギー
CLOROX COMPANY	76	106	1,413	153,138	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	91	121	855	92,692	素材
CARNIVAL CORP	228	341	1,715	185,870	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	167	233	1,717	186,168	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	139	—	—	—	保険
CONAGRA FOODS INC	251	358	1,641	177,913	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	174	244	1,823	197,560	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	487	656	1,158	125,582	銀行
STERICYCLE INC	50	70	665	72,165	商業・専門サービス
INTEL CORP	2,866	3,903	11,734	1,271,637	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	3,030	4,199	11,213	1,215,188	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	59	75	694	75,231	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	76	105	1,067	115,688	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	259	361	5,321	576,720	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	721	993	1,987	215,425	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	184	257	1,887	204,538	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	180	244	1,673	181,358	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	408	558	933	101,209	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	124	337	1,835	198,924	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	120	177	855	92,695	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	405	1,121	6,394	692,974	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	6	80	8,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	450	624	9,621	1,042,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	106	145	627	68,002	銀行
NORTHERN TRUST CORP	132	181	1,258	136,407	各種金融
MICROSOFT CORP	4,642	6,278	32,051	3,473,441	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	54	73	635	68,909	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	—	140	806	87,420	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	381	538	455	49,346	小売
STARBUCKS CORP	887	1,227	6,903	748,165	消費者サービス
ORACLE CORP	2,101	2,646	10,492	1,137,093	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	181	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	213	282	861	93,353	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	33	336	3,024	327,783	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	60	81	2,143	232,244	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	299	423	1,572	170,427	ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	63	—	—	—	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	113	158	1,021	110,740	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	49	68	1,173	127,221	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	80	111	1,027	111,298	小売
LAM RESEARCH CORP	94	130	989	107,273	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	47	67	626	67,858	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,274	2,054	12,749	1,381,662	メディア
XILINX INC	157	212	914	99,151	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	209	292	1,665	180,446	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	84	199	1,235	133,837	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	894	1,192	10,002	1,083,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	96	127	1,052	114,113	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	21	30	1,938	210,122	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	160	207	2,124	230,251	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	246	—	—	—	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	152	205	343	37,206	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	193	268	1,400	151,781	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	532	741	2,772	300,457	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	48	72	317	34,387	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	—	42	559	60,675	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	57	462	50,164	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	135	187	1,106	119,913	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	147	208	776	84,156	メディア
SALESFORCE.COM INC	355	522	3,958	429,008	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	83	114	518	56,184	小売
ALPHABET INC-CL A	168	240	17,604	1,907,831	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	58	—	—	—	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	37	408	44,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	62	87	412	44,704	資本財
GARMIN LTD	67	94	380	41,180	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	150	207	490	53,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	985	1,243	6,484	702,757	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	133	199	680	73,737	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	91	129	622	67,450	ソフトウェア・サービス
LINER TECHNOLOGY CORP	142	197	874	94,744	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	168	235	855	92,758	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	233	329	23,514	2,548,264	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	153	206	1,558	168,898	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	85	118	903	97,918	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	98	128	895	97,076	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	—	242	613	66,466	各種金融
CERNER CORP	182	254	1,384	150,029	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	—	321	4,622	500,937	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	87	124	471	51,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	68	83	707	76,670	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	169	250	1,322	143,361	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	320	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WASTE CONNECTIONS INC	—	101	701	75,982	商業・専門サービス
EBAY INC	662	893	2,121	229,935	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	323	445	1,604	173,929	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	122	184	1,457	157,946	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	31	41	5,220	565,696	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	684	980	14,010	1,518,322	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BB&T CORP	425	670	2,276	246,674	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	666	903	3,601	390,272	各種金融
BORGWARNER INC	135	185	631	68,433	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	163	194	378	40,973	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	60	97	1,266	137,251	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	496	661	4,903	531,437	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	129	161	1,227	132,970	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	42	54	470	50,967	保険
AETNA INC	208	288	3,236	350,759	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	146	204	984	106,729	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	291	408	2,666	289,018	公益事業
AON PLC	160	226	2,391	259,177	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	381	493	1,872	202,950	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	56	78	423	45,902	保険
HESS CORP	159	232	1,354	146,747	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	197	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	231	288	658	71,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	160	221	640	69,386	各種金融
RED HAT INC	111	151	1,093	118,550	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	43	58	605	65,629	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	131	186	885	95,952	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	105	147	747	80,980	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	185	242	565	61,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	90	138	979	106,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	224	342	333	36,117	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	140	184	4,928	534,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	84	121	1,683	182,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	280	412	3,968	430,040	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	142	203	1,701	184,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	110	137	600	65,105	小売
CELGENE CORP	473	650	6,517	706,339	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	71	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	360	503	3,074	333,222	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	435	559	4,118	446,292	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	116	154	738	80,027	運輸
FASTENAL CO	166	227	1,052	114,083	資本財
FISERV INC	144	189	1,996	216,368	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	347	462	556	60,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	27	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,451	1,745	685	74,323	メディア
SANDISK CORP	130	166	1,265	137,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	3,477	4,612	42,674	4,624,644	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	91	128	861	93,387	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	485	659	657	71,206	銀行
SIGMA-ALDRICH	70	—	—	—	素材
NABORS INDUSTRIES LTD	150	—	—	—	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	117	186	2,589	280,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	39	52	590	64,014	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	88	118	863	93,588	運輸
CENTURYLINK INC	337	454	1,286	139,420	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	85	114	350	38,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	246	345	1,371	148,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	65	—	—	—	自動車・自動車部品
ONEOK INC	123	173	696	75,518	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	188	709	3,607	390,945	食品・飲料・タバコ
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	299	—	—	—	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	193	247	463	50,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	85	117	721	78,155	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	43	60	897	97,216	小売
CONSOL ENERGY INC	136	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	255	311	1,006	109,119	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	100	143	2,335	253,054	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	315	—	—	—	エネルギー
PARTNERRE LTD	26	—	—	—	保険
COOPER COS INC/THE	28	40	624	67,634	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	90	132	929	100,690	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	183	255	1,435	155,538	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	63	81	455	49,330	保険
OWENS-ILLINOIS INC	99	—	—	—	素材
AGCO CORP	52	55	287	31,164	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	87	122	356	38,584	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	84	117	1,766	191,402	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	61	102	1,149	124,569	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29	193	568	61,645	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	277	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	375	495	1,796	194,637	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	109	144	1,371	148,597	各種金融
TESORO CORP	75	99	775	83,994	エネルギー
FNF GROUP	149	207	693	75,202	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	66	98	2,536	274,895	各種金融
NASDAQ INC	70	94	600	65,084	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	99	149	558	60,507	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	212	288	1,166	126,366	メディア
AUTOLIV INC	53	72	908	98,437	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	178	249	729	79,104	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18	25	1,170	126,886	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	39	56	684	74,132	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	73	95	937	101,638	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	265	367	965	104,617	小売
ARROW ELECTRONICS INC	57	77	470	51,029	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	102	139	1,599	173,329	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	78	101	507	54,977	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	185	271	480	52,038	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	33	46	868	94,152	素材
RANGE RESOURCES CORP	100	140	606	65,756	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	226	315	385	41,825	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	51	78	899	97,437	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	35	48	411	44,550	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	66	96	707	76,703	公益事業
OCEANEERING INTL INC	63	80	265	28,719	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	72	96	666	72,272	消費者サービス
HANESBRANDS INC	237	324	871	94,447	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	593	819	7,900	856,209	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	310	418	801	86,846	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AERCAP HOLDINGS NV	—	76	305	33,150	資本財
AVNET INC	82	109	431	46,778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	190	263	686	74,418	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	80	117	12,692	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	397	556	1,719	186,357	エネルギー
TRANSIGM GROUP INC	29	44	1,104	119,676	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	94	108	1,345	145,765	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	184	253	386	41,832	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	240	319	1,885	204,336	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	268	353	1,959	212,337	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	63	93	576	62,516	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	—	45	481	52,203	資本財
PRECISION CASTPARTS CORP	84	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	49	65	366	39,693	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	198	234	929	100,733	保険
TIME WARNER CABLE	166	234	5,076	550,133	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	36	50	1,018	110,419	小売
LKQ CORP	181	252	823	89,292	小売
HORMEL FOODS CORP	86	240	960	104,069	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	88	123	927	100,543	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	66	85	248	26,910	小売
HARRIS CORP	62	103	786	85,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	90	122	2,084	225,944	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	99	135	410	44,485	エネルギー
NRG ENERGY INC	203	262	414	44,944	公益事業
INVESCO LTD	254	350	1,018	110,364	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	92	133	1,098	119,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	83	115	560	60,705	各種金融
TERADATA CORP	89	113	313	33,963	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	99	137	731	79,321	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	70	107	1,248	135,287	エネルギー
MSCI INC	—	81	620	67,230	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	54	76	305	33,124	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	90	153	1,526	165,413	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	921	1,281	13,050	1,414,277	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,169	1,610	12,447	1,348,965	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	115	156	1,479	160,369	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	26	34	428	46,408	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	246	380	931	100,925	エネルギー
FLOWSERVE CORP	80	108	505	54,744	資本財
HELMERICH & PAYNE	63	89	532	57,725	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	111	—	—	—	公益事業
ENERGEN CORP	43	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	144	237	968	104,907	電気通信サービス
LORILLARD INC	213	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	45	62	416	45,144	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	72	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	164	228	641	69,468	メディア
RESMED INC	82	115	664	71,990	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	—	69	675	73,193	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	145	197	924	100,152	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	76	101	727	78,843	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CHURCH & DWIGHT CO INC	78	108	1,045	113,296	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	56	76	635	68,891	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	48	—	—	—	公益事業
PERRIGO CO PLC	83	121	1,124	121,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	126	129	305	33,103	資本財
FMC CORP	79	110	521	56,506	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	72	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	56	79	635	68,914	資本財
EVERSOURCE ENERGY	189	265	1,524	165,248	公益事業
NETSUITE INC	20	32	257	27,896	ソフトウェア・サービス
ALLERGAN PLC	223	326	7,264	787,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	40	53	764	82,889	素材
CROWN HOLDINGS INC	81	116	633	68,642	素材
CALPINE CORP	196	285	429	46,515	公益事業
EATON VANCE CORP	70	95	330	35,773	各種金融
DELTA AIR LINES INC	124	165	702	76,090	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	119	163	1,389	150,630	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	149	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	107	151	1,127	122,210	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	95	133	1,033	111,955	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	179	243	2,024	219,393	小売
FORTINET INC	—	121	395	42,836	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	55	79	361	39,210	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	17	22	824	89,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	108	141	466	50,579	銀行
QEP RESOURCES INC	99	—	—	—	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	599	970	524	56,819	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	761	1,169	3,635	393,967	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	112	958	103,884	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	252	315	2,586	280,318	素材
HCA HOLDINGS INC	179	270	2,168	235,045	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	268	321	283	30,757	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	121	—	—	—	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	83	—	—	—	素材
HOLLYFRONTIER CORP	111	144	421	45,721	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	165	441	1,584	171,733	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	87	648	70,268	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	—	132	738	80,018	資本財
XYLEM INC	107	148	636	68,936	資本財
TRIPADVISOR INC	69	97	642	69,664	小売
MEDIVATION INC	46	140	858	92,999	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	35	50	758	82,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	77	120	826	89,601	銀行
ALLEGHANY CORP	9	12	670	72,686	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	47	63	2,357	255,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	327	441	3,505	379,938	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,186	1,878	22,452	2,433,182	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	166	235	979	106,096	公益事業
ALBEMARLE CORP	66	92	693	75,202	素材
PVH CORP	48	68	568	61,635	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	64	95	1,231	133,407	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
KINDER MORGAN INC	1,067	1,570	2,679	290,397	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	166	—	—	—	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	207	286	1,490	161,539	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	175	231	1,630	176,689	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	45	69	1,519	164,639	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	95	141	492	53,351	資本財
SPLUNK INC	—	106	513	55,700	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	103	—	—	—	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	348	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP	121	169	520	56,427	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	37	51	442	47,969	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	944	1,352	8,481	919,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A	52	—	—	—	メディア
TESLA MOTORS INC	52	81	1,699	184,149	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	133	186	610	66,190	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	85	122	387	41,973	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	74	106	545	59,087	各種金融
ZOETIS INC	296	392	1,804	195,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	69	96	554	60,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	224	314	384	41,639	メディア
SPRINT CORP	479	644	224	24,374	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	—	197	548	59,450	公益事業
SNAP-ON INC	34	48	782	84,786	資本財
AGL RESOURCES INC	—	102	671	72,758	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	122	152	670	72,618	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	226	481	702	76,092	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	86	130	723	78,456	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	58	93	666	72,194	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	79	125	860	93,293	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	54	75	1,024	111,050	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	56	76	287	31,164	資本財
PHARMACYCLICS INC	38	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	46	65	988	107,102	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	158	376	40,851	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	171	257	18,405	1,994,641	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	137	344	37,377	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP	246	300	383	41,571	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	102	178	241	26,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	59	77	476	51,642	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	107	133	437	47,365	運輸
VOYA FINANCIAL INC	135	177	542	58,831	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	28	36	168	18,295	素材
ANTERO RESOURCES CORP	32	67	174	18,954	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	41	77	508	55,060	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC	49	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C	124	—	—	—	メディア
ALLY FINANCIAL INC	255	360	612	66,428	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	235	408	911	98,735	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	—	112	580	62,917	ソフトウェア・サービス
JARDEN CORP	108	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	67	133	621	67,316	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	41	67	944	102,384	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SIGNET JEWELERS LTD	45	62	649	70,426	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	99	689	2,064	223,770	各種金融	
QORVO INC	86	116	538	58,307	半導体・半導体製造装置	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	70	99	328	35,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	146	690	74,830	保険	
ACUITY BRANDS INC	—	36	913	98,995	資本財	
JONES LANG LASALLE INC	—	37	417	45,228	不動産	
ARAMARK	—	188	621	67,363	消費者サービス	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	435	967	104,862	銀行	
LEAR CORP	—	62	718	77,836	自動車・自動車部品	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	63	340	36,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WHITEWAVE FOODS CO	—	146	644	69,883	食品・飲料・タバコ	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	119	336	36,459	素材	
RITE AID CORP	—	857	686	74,344	食品・生活必需品小売り	
BAXALTA INC	—	588	2,503	271,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	322	823	89,256	エネルギー	
WESTROCK CO	—	223	955	103,546	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	502	4,277	463,512	食品・飲料・タバコ	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	909	3,613	391,572	ソフトウェア・サービス	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	42	208	22,570	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	—	83	226	24,531	ソフトウェア・サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	1,492	2,391	259,164	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOBILEYE NV	—	65	239	25,950	ソフトウェア・サービス	
AMERCO	—	6	241	26,152	運輸	
CDW CORP/DE	—	119	494	53,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDNAX INC	—	77	538	58,397	ヘルスケア機器・サービス	
SABRE CORP	—	172	503	54,556	ソフトウェア・サービス	
WR GRACE & CO	—	59	461	49,986	素材	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	143	503	54,607	耐久消費財・アパレル	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	167	529	57,329	メディア	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	—	74	240	26,018	メディア	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	480	294	31,938	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	200	1,066	115,522	資本財	
小計	株数・金額	184,539	260,387	1,520,759	164,804,668	
	銘柄数<比率>	593	596	—	<61.0%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	855	1,228	9,408	793,455	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	176	247	1,000	84,359	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	213	286	1,508	127,176	メディア	
TRANSCANADA CORP	420	588	3,044	256,756	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	214	301	1,486	125,393	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	362	506	2,182	184,082	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	340	470	592	49,940	素材	
BARRICK GOLD CORP	690	965	2,288	192,948	素材	
BCE INC	85	120	715	60,302	電気通信サービス	
AGRIUM INC	85	109	1,213	102,352	素材	
BOMBARDIER INC-B	847	1,596	323	27,321	資本財	
BANK OF MONTREAL	382	530	4,319	364,263	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	330	733	3,192	269,261	不動産	
BANK OF NOVA SCOTIA	720	995	6,247	526,860	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	189	268	906	76,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	160	218	338	28,568	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CAMECO CORP	237	330	499	42,132	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	132	195	527	44,481	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	235	328	3,297	278,068	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	647	907	3,364	283,691	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	483	659	5,040	425,081	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	44	59	820	69,188	小売
ENBRIDGE INC	503	760	3,895	328,465	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	18	1,160	97,857	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	133	183	1,067	90,047	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	206	292	442	37,331	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	61	80	297	25,056	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	135	188	1,297	109,392	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,166	1,631	2,984	251,702	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	246	335	1,755	148,061	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	193	284	1,185	99,942	銀行
ONEX CORPORATION	53	71	563	47,480	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	491	691	1,415	119,399	素材
POWER CORP OF CANADA	220	310	894	75,394	保険
POWER FINANCIAL CORP	147	208	650	54,867	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	236	337	810	68,348	メディア
SUNCOR ENERGY INC	860	1,310	4,515	380,798	エネルギー
TRANSALTA CORP	169	—	—	—	公益事業
WESTON (GEORGE) LTD	30	43	473	39,967	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	101	120	2,124	179,116	運輸
ENCANA CORP	492	699	627	52,875	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	124	180	1,078	90,985	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	103	145	318	26,840	資本財
GOLDCORP INC	484	687	1,654	139,506	素材
KINROSS GOLD CORP	689	1,019	686	57,918	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	90	124	638	53,874	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	179	247	845	71,278	保険
METHANEX CORP	56	73	285	24,088	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	491	849	302	25,488	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	46	70	133	11,298	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	139	192	732	61,753	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	152	211	879	74,181	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	299	424	365	30,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	116	116	471	39,735	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	359	571	527	44,444	素材
YAMANA GOLD INC	546	785	484	40,844	素材
FORTIS INC	163	236	959	80,881	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	248	347	1,872	157,929	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	431	580	361	30,471	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,091	1,533	8,592	724,602	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	93	145	1,301	109,732	素材
SILVER WHEATON CORP	241	361	893	75,377	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	33	133	285	24,114	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	59	87	360	30,425	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	74	107	390	32,962	公益事業
METRO INC	148	199	851	71,825	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	71	101	719	60,677	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	78	109	964	81,367	保険

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
CRESCENT POINT ENERGY CORP	248	419	853	71,940	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	489	692	1,314	110,877	エネルギー	
MEG ENERGY CORP	94	—	—	—	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	188	288	592	49,934	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	289	—	—	—	エネルギー	
BAYTEX ENERGY CORP	121	—	—	—	エネルギー	
TOURMALINE OIL CORP	102	160	491	41,463	エネルギー	
ENERPLUS CORP	118	—	—	—	エネルギー	
NEW GOLD INC	313	—	—	—	素材	
PEMBINA PIPELINE CORP	201	309	1,142	96,388	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	63	93	390	32,892	エネルギー	
CATAMARAN CORP	122	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
DOLLARAMA INC	75	99	903	76,181	小売	
KEYERA CORP	100	143	527	44,522	エネルギー	
ALTAGAS LTD	79	126	374	31,579	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	87	124	395	33,336	エネルギー	
ATCO LTD -CLASS I	47	66	279	23,548	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	60	97	205	17,349	不動産	
INTER PIPELINE LTD	193	280	724	61,085	エネルギー	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	79	151	370	31,261	エネルギー	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	133	320	27,030	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11	16	816	68,825	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	35	—	—	—	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	116	168	888	74,962	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	41	57	247	20,875	素材	
VERESEN INC	—	258	235	19,886	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	23	517	43,675	素材	
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	323	485	40,912	各種金融	
LINAMAR CORP	—	39	203	17,125	自動車・自動車部品	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	92	395	33,314	商業・専門サービス	
小 計	株数・金額	23,185	32,985	118,114	9,960,633	
	銘柄数<比率>	93	90	—	<3.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	631	882	620	76,814	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	816	1,141	1,679	207,947	各種金融	
METRO AG	95	147	416	51,589	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	469	655	6,184	765,698	資本財	
RWE AG	290	407	466	57,805	公益事業	
BASF SE	544	759	5,194	643,140	素材	
VOLKSWAGEN AG	17	29	408	50,600	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	570	796	4,728	585,485	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	105	146	1,497	185,453	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	1,188	1,661	1,332	164,978	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	196	274	2,107	260,903	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	490	684	6,841	847,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINDE AG	110	153	1,942	240,552	素材	
ALLIANZ SE-REG	270	377	5,241	648,960	保険	
MAN SE	20	29	278	34,526	資本財	
CONTINENTAL AG	65	90	1,700	210,568	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	671	933	1,123	139,043	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	90	126	611	75,763	自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	136	204	255	31,656	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	39	55	309	38,286	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	574	801	2,117	262,204	運輸	
SAP SE	546	812	5,541	686,046	ソフトウェア・サービス	
CELESIO AG	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	129	181	773	95,727	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	114	159	1,215	150,532	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	129	180	1,353	167,604	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	22	34	174	21,612	運輸	
ADIDAS AG	123	173	1,960	242,706	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,881	2,669	4,176	517,039	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	102	137	2,181	270,083	保険	
THYSSENKRUPP AG	270	305	581	72,000	素材	
BEIERSDORF AG	58	82	657	81,376	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	84	116	883	109,365	素材	
MERCK KGAA	77	106	858	106,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	96	153	1,998	247,389	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	53	75	334	41,392	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	224	315	2,044	253,173	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	171	279	760	94,121	不動産	
GEA GROUP AG	109	150	608	75,315	資本財	
SYMRISE AG	73	102	584	72,372	素材	
K+S AG-REG	102	158	355	44,066	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	68	85	775	95,956	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	73	102	443	54,900	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	32	44	309	38,288	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	35	49	477	59,157	保険	
BRENNTAG AG	92	127	609	75,516	資本財	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12	—	—	—	メディア	
AXEL SPRINGER SE	24	37	187	23,168	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	40	57	212	26,257	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	347	625	285	35,341	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	52	73	337	41,728	資本財	
VONOVIA SE	203	386	1,174	145,390	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	114	331	41,005	素材	
ZALANDO SE	—	69	206	25,546	小売	
小 計	株 数	金 額	12,785	18,327	77,453	9,589,511
	銘柄 数 < 比率 >		52	52	—	< 3.6% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	692	961	1,260	156,119	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	2,544	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	7,501	10,499	2,368	293,275	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	5,980	9,508	805	99,707	電気通信サービス	
ENI SPA	1,505	2,105	2,827	350,055	エネルギー	
UNICREDIT SPA	2,601	3,948	1,120	138,745	銀行	
ENEL SPA	3,904	6,331	2,513	311,218	公益事業	
SAIPEM SPA	160	4,956	181	22,465	エネルギー	
ATLANTIA SPA	246	342	823	101,976	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	556	762	165	20,505	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	99	139	664	82,317	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	360	466	298	37,009	各種金融	
SNAM SPA	1,246	1,760	930	115,227	公益事業	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELECOM ITALIA-RSP	3,577	4,971	338	41,914	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	214	308	135	16,801	銀行	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	244	350	377	46,698	資本財	
PIRELLI & C.	139	—	—	—	自動車・自動車部品	
UBI BANCA SPA	509	734	232	28,795	銀行	
TERNA SPA	917	1,281	620	76,875	公益事業	
UNIPOLSAI SPA	523	908	173	21,433	保険	
PRYSMIAN SPA	123	160	345	42,738	資本財	
EXOR SPA	56	93	299	37,096	各種金融	
ENEL GREEN POWER SPA	1,081	—	—	—	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	34,788 23	50,592 20	16,484 —	2,040,977 < 0.8% >	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	109	154	1,402	173,647	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	165	231	3,384	419,048	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	232	366	499	61,849	自動車・自動車部品	
AXA SA	1,077	1,627	3,391	419,891	保険	
DANONE	343	487	2,952	365,563	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	326	458	1,106	137,014	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	719	960	1,580	195,653	メディア	
INGENICO GROUP	—	45	465	57,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALCATEL-LUCENT SA	1,680	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	429	600	1,981	245,282	銀行	
AIR LIQUIDE SA	204	284	2,711	335,660	素材	
TOTAL SA	1,268	1,816	7,788	964,328	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	266	394	1,517	187,926	資本財	
ZODIAC AEROSPACE	110	168	351	43,524	資本財	
VINCI SA	279	396	2,560	317,049	資本財	
LAFARGE SA	110	—	—	—	素材	
SANOFI	708	971	6,752	836,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	254	380	755	93,545	公益事業	
L'OREAL	149	207	3,310	409,841	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	124	175	680	84,200	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	311	461	2,535	313,981	資本財	
BNP PARIBAS	627	876	3,866	478,694	銀行	
ESSILOR INTERNATIONAL	121	169	1,936	239,786	ヘルスケア機器・サービス	
CAPGEMINI	84	135	1,105	136,853	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	32	48	245	30,371	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	45	65	912	112,927	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	15	21	697	86,299	耐久消費財・アパレル	
VALLOUREC SA	63	—	—	—	エネルギー	
SODEXO	56	77	691	85,612	消費者サービス	
KERING	44	62	904	111,985	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	76	106	734	90,985	ソフトウェア・サービス	
TECHNIP SA	59	87	411	50,911	エネルギー	
CHRISTIAN DIOR SE	32	45	684	84,698	耐久消費財・アパレル	
ATOS SE	47	72	584	72,428	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	1,098	1,644	2,416	299,232	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	100	142	200	24,768	保険	
IMERYS SA	19	29	183	22,704	素材	
SAFRAN SA	173	258	1,548	191,736	資本財	
RENAULT SA	113	158	1,291	159,885	自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PUBLICIS GROUPE	111	156	982	121,689	メディア
LAGARDERE SCA	71	95	202	25,118	メディア
JC DECAUX SA	40	61	218	27,078	メディア
SOCIETE BIC SA	17	23	294	36,493	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	99	167	487	60,359	資本財
THALES SA	54	86	666	82,567	資本財
PERNOD RICARD SA	125	175	1,679	207,901	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	610	874	795	98,490	銀行
ENGIE	860	1,215	1,595	197,600	公益事業
ALSTOM	127	128	284	35,219	資本財
ARKEMA	39	55	396	49,122	素材
LEGRAND SA	157	220	1,074	133,056	資本財
SCOR SE	91	126	371	45,943	保険
ADP	17	24	263	32,653	運輸
EDF	145	201	228	28,335	公益事業
NATIXIS	554	779	327	40,543	銀行
WENDEL	18	23	247	30,634	各種金融
BUREAU VERITAS SA	157	221	446	55,337	商業・専門サービス
EURAZEO	22	32	202	25,084	各種金融
EURAZEO-NEW	1	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	179	255	386	47,864	公益事業
ILIAD SA	15	21	426	52,751	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	92	141	384	47,600	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	282	393	442	54,794	運輸
EDENRED	120	172	295	36,566	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	14	19	140	17,357	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	163	255	335	41,582	資本財
BOLLORE	511	711	239	29,617	運輸
NUMERICABLE-SFR	58	91	252	31,274	電気通信サービス
小 計	株 数	金 額	77,814	9,634,233	
銘 柄 数 < 比 率 >	67	64	—	< 3.6% >	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N. V.	135	183	351	43,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	566	786	490	60,697	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	535	743	499	61,847	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	105	400	49,595	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	348	489	2,714	336,104	資本財
STMICROELECTRONICS NV	371	512	242	29,992	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	46	66	380	47,085	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	180	249	852	105,562	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	1,900	2,654	921	114,127	電気通信サービス
AKZO NOBEL	145	204	1,254	155,337	素材
HEINEKEN NV	136	190	1,575	195,012	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	554	787	1,819	225,240	資本財
RELX NV	414	822	1,221	151,245	メディア
AEGON NV	1,074	1,506	727	90,046	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	530	688	1,327	164,408	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	75	105	492	60,973	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	59	83	602	74,621	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	101	149	788	97,564	素材
ING GROEP NV-CVA	2,287	3,201	3,345	414,151	銀行
ASML HOLDING NV	207	286	2,326	288,076	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNILEVER NV-CVA	966	1,346	5,282	654,058	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	41	58	271	33,622	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	51	72	254	31,523	資本財	
DELTA LLOYD NV	130	—	—	—	保険	
TNT EXPRESS NV	259	417	332	41,214	運輸	
OCI NV	49	73	105	13,119	素材	
NN GROUP NV	93	261	776	96,078	保険	
ALTICE NV - B	—	87	121	15,008	メディア	
ALTICE NV - A	—	310	426	52,806	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,264	16,445	29,906	3,702,693	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	28	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	1,061	1,432	297	36,772	銀行	
ENDESA SA	191	265	481	59,643	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	102	158	435	53,896	資本財	
IBERDROLA SA	3,070	4,556	2,751	340,701	公益事業	
TELEFONICA SA	2,651	3,725	3,449	427,117	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	8,525	11,932	4,819	596,703	銀行	
BANKINTER SA	403	553	352	43,583	銀行	
REPSOL SA	615	908	1,021	126,497	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,743	5,369	2,960	366,536	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	208	293	494	61,215	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	645	898	2,514	311,377	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	239	429	622	77,044	運輸	
MAPPRE SA	539	892	189	23,491	保険	
FERROVIAL SA	246	390	707	87,546	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	237	—	—	—	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	103	153	139	17,220	資本財	
ENAGAS SA	122	182	478	59,299	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	65	90	705	87,346	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	2,560	4,311	663	82,094	銀行	
CAIXABANK S.A	1,364	2,194	525	65,022	銀行	
GRIFOLS SA	88	245	452	55,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	264	361	1,445	178,968	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	493	681	447	55,455	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	371	486	232	28,794	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	2,716	3,782	289	35,829	銀行	
AENA SA	36	55	679	84,170	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	30,669	44,354	27,157	3,362,311	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	25	—	< 1.2% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	128	166	540	66,937	保険	
UCB SA	74	104	697	86,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	477	665	7,400	916,197	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	48	66	486	60,178	各種金融	
DELHAIZE GROUP	60	85	787	97,509	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	55	78	352	43,607	素材	
COLRUYT SA	42	58	293	36,334	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	149	207	947	117,290	銀行	
SOLVAY SA	34	61	549	67,977	素材	
PROXIMUS	90	126	354	43,869	電気通信サービス	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELENET GROUP HOLDING NV	30	46	197	24,454	メディア	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,193 11	1,667 11	12,605 —	1,560,740 <0.6%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	166	232	545	67,479	銀行	
OMV AG	85	123	310	38,419	エネルギー	
VOESTALPINE AG	65	93	269	33,338	素材	
IMMOFINANZ AG	554	—	—	—	不動産	
ANDRITZ AG	42	64	291	36,069	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	69	103	126	15,609	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	24	—	—	—	保険	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,008 7	616 5	1,542 —	190,916 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	22	31	235	29,208	メディア	
TENARIS SA	276	386	435	53,885	エネルギー	
SES	180	270	653	80,891	メディア	
ARCELORMITTAL	590	1,408	612	75,848	素材	
ALTICE SA	51	—	—	—	メディア	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,122 5	2,096 4	1,937 —	239,833 <0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	2,219	4,772	2,214	274,159	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	323	452	335	41,518	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	67	94	304	37,728	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	314	439	731	90,610	素材	
FORTUM OYJ	267	371	473	58,605	公益事業	
KONE OYJ-B	187	277	1,096	135,813	資本財	
METSO OYJ	67	93	189	23,406	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	265	368	1,443	178,680	保険	
WARTSILA OYJ ABP	86	121	446	55,280	資本財	
ELISA OYJ	84	118	384	47,544	電気通信サービス	
NESTE OYJ	73	106	307	38,073	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	60	84	257	31,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,019 12	7,301 12	8,184 —	1,013,278 <0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	96	135	1,084	134,317	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	70	792	98,107	消費者サービス	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	472	472	—	—	銀行	
BANK OF IRELAND	16,439	23,370	574	71,180	銀行	
CRH PLC	490	691	1,765	218,569	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,499 4	24,739 5	4,217 —	522,174 <0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,362	1,934	601	74,522	公益事業	
JERONIMO MARTINS	149	207	285	35,340	食品・生活必需品小売り	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	21,117	35,849	114	14,203	銀行	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
GALP ENERGIA SGPS SA	227	383	451	55,924	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	22,857	38,374	1,453	179,990	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	153,656	225,438	258,756	32,036,661	
	銘柄 数 < 比 率 >	237	230	—	< 11.9% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	9,750	13,882	2,271	355,493	銀行	
BP PLC	10,812	15,163	5,476	857,241	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	33,849	47,240	3,103	485,714	銀行	
ASTRAZENECA PLC	748	1,045	4,110	643,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	235	326	358	56,078	資本財	
NEXT PLC	90	120	640	100,321	小売	
DIAGEO PLC	1,490	2,080	3,922	613,952	食品・飲料・タバコ	
SKY PLC	611	856	796	124,729	メディア	
BAE SYSTEMS PLC	1,867	2,614	1,282	200,685	資本財	
UNILEVER PLC	760	1,060	3,341	523,004	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	4,811	6,742	1,074	168,167	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	671	920	1,130	177,002	メディア	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	966	1,348	563	88,208	小売	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	383	526	3,612	565,489	家庭用品・パーソナル用品	
PRUDENTIAL PLC	1,521	2,127	2,781	435,312	保険	
BG GROUP PLC	2,023	—	—	—	エネルギー	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,519	4,916	1,066	166,975	保険	
SAGE GROUP PLC/THE	637	893	535	83,815	ソフトウェア・サービス	
HSBC HOLDINGS PLC	11,377	16,192	6,981	1,092,761	銀行	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,105	1,542	6,548	1,024,965	食品・飲料・タバコ	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	406	581	550	86,227	公益事業	
SCHRODERS PLC	74	102	252	39,525	各種金融	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,501	2,873	614	96,116	銀行	
BHP BILLITON PLC	1,250	1,747	1,461	228,824	素材	
IMPERIAL BRANDS PLC	567	793	3,015	472,056	食品・飲料・タバコ	
WPP PLC	778	1,070	1,713	268,132	メディア	
CENTRICA PLC	2,950	4,221	886	138,743	公益事業	
BT GROUP PLC	4,824	7,008	3,062	479,275	電気通信サービス	
SSE PLC	587	839	1,270	198,906	公益事業	
STANDARD CHARTERED PLC	1,464	2,708	1,346	210,814	銀行	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,117	1,520	1,001	156,737	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	158,293	112,647	11	1,763	資本財	
COMPASS GROUP PLC	987	1,358	1,699	266,069	消費者サービス	
KINGFISHER PLC	1,400	1,891	686	107,467	小売	
PEARSON PLC	486	678	548	85,816	メディア	
SEVERN TRENT PLC	144	203	453	70,994	公益事業	
RIO TINTO PLC	753	1,025	2,083	326,161	素材	
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,881	4,027	5,940	929,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SABMILLER PLC	573	803	3,398	531,888	食品・飲料・タバコ	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	121	338	53,053	各種金融	
3I GROUP PLC	582	793	378	59,256	各種金融	
GKN PLC	968	1,415	396	62,118	自動車・自動車部品	
VODAFONE GROUP PLC	15,710	21,964	4,882	764,255	電気通信サービス	
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,256	1,835	347	54,409	食品・生活必需品小売り	
SAINSBURY (J) PLC	721	1,109	291	45,685	食品・生活必需品小売り	
AVIVA PLC	2,370	3,343	1,415	221,612	保険	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
CAPITA PLC	394	552	605	94,698	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	588	806	334	52,320	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	122	159	460	72,090	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	609	841	403	63,187	保険
WHITBREAD PLC	108	150	591	92,514	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,230	3,112	3,103	485,719	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	831	1,162	1,100	172,192	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	155	210	825	129,143	資本財
BUNZL PLC	199	277	578	90,475	資本財
COBHAM PLC	670	976	157	24,708	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	825	1,160	716	112,109	素材
INTERTEK GROUP PLC	95	134	448	70,198	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	518	725	221	34,740	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	265	367	429	67,293	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	140	171	463	72,557	消費者サービス
CARNIVAL PLC	107	156	563	88,196	消費者サービス
PERSIMMON PLC	180	252	494	77,330	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	483	641	263	41,275	資本財
ICAP PLC	332	455	211	33,043	各種金融
ITV PLC	2,282	3,161	680	106,551	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	185	258	667	104,492	各種金融
G4S PLC	933	1,293	249	39,085	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	107	310	48,651	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	228	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	826	432	67,755	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	160	225	222	34,870	資本財
REXAM PLC	417	590	371	58,090	素材
SMITH & NEPHEW PLC	531	740	856	134,045	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	276	394	240	37,602	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	2,685	482	75,505	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,318	3,260	5,655	885,192	エネルギー
PETROFAC LTD	153	209	171	26,912	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	145	205	373	58,414	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,446	3,280	5,732	897,187	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	2,904	4,078	701	109,787	保険
INVESTEC PLC	327	470	226	35,413	各種金融
STANDARD LIFE PLC	1,166	1,628	520	81,408	保険
EXPERIAN PLC	587	799	1,011	158,360	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	302	408	63,970	素材
WEIR GROUP PLC/THE	125	181	202	31,759	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	211	294	914	143,084	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	233	317	135	21,182	素材
TULLOW OIL PLC	532	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	349	490	2,053	321,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	251	374	300	46,960	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	117	174	334	52,426	保険
FRESNILLO PLC	130	178	191	29,992	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	51	76	469	73,409	素材
AGGREKO PLC	151	207	218	34,260	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	148	208	201	31,496	商業・専門サービス
ST JAMES' S PLACE PLC	—	434	376	58,983	保険
GLENCORE PLC	6,585	10,122	1,385	216,827	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等			
	株 数	株 数	評 価 額					
			外貨建金額	邦貨換算金額				
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円				
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	551	759	202	31,755	各種金融			
HARGREAVES LANSDOWN PLC	140	215	271	42,558	各種金融			
CRODA INTERNATIONAL PLC	79	113	341	53,383	素材			
MELROSE INDUSTRIES PLC	584	—	—	—	資本財			
COCA-COLA HBC AG-DI	115	165	231	36,253	食品・飲料・タバコ			
EASYJET PLC	96	141	210	32,992	運輸			
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	886	1,127	427	66,859	保険			
ROYAL MAIL PLC	382	743	370	57,943	運輸			
ASHTREAD GROUP PLC	300	416	374	58,567	資本財			
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	165	236	89	13,935	小売			
MERLIN ENTERTAINMENT	418	587	253	39,674	消費者サービス			
TUI AG-DI	269	410	432	67,656	消費者サービス			
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	304	266	41,705	ヘルスケア機器・サービス			
AUTO TRADER GROUP PLC	—	792	302	47,320	ソフトウェア・サービス			
WORLDPAY GROUP PLC	—	1,170	307	48,199	ソフトウェア・サービス			
小 計	株 数 銘柄 数	金 額 率 < 比 率 >	325,695	353,365	129,802	20,316,680	—	<7.5%>
(スイス)			千スイスフラン					
NESTLE SA-REG	1,912	2,637	19,187	2,141,894	食品・飲料・タバコ			
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	309	431	2,684	299,657	耐久消費財・アパレル			
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	904	1,487	2,034	227,107	各種金融			
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	135	376	1,660	185,328	素材			
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	416	581	14,184	1,583,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
GIVAUDAN-REG	5	7	1,473	164,515	素材			
SONOVA HOLDING AG-REG	31	44	602	67,216	ヘルスケア機器・サービス			
ZURICH INSURANCE GROUP AG	88	124	2,686	299,863	保険			
SYNGENTA AG-REG	55	76	3,012	336,333	素材			
LONZA GROUP AG-REG	31	43	739	82,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
SWATCH GROUP AG/THE-REG	29	40	257	28,722	耐久消費財・アパレル			
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	26	36	643	71,778	資本財			
GEBERIT AG-REG	22	31	1,154	128,925	資本財			
SWISS RE AG	208	290	2,527	282,098	保険			
SWATCH GROUP AG/THE-BR	18	25	822	91,852	耐久消費財・アパレル			
PARGESA HOLDING SA-BR	19	27	173	19,334	各種金融			
NOVARTIS AG-REG	1,364	1,882	13,788	1,539,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
ADECCO GROUP AG-REG	101	137	808	90,222	商業・専門サービス			
SWISSCOM AG-REG	13	21	1,035	115,627	電気通信サービス			
ABB LTD-REG	1,302	1,819	3,681	410,990	資本財			
SGS SA-REG	3	4	951	106,256	商業・専門サービス			
SULZER AG-REG	13	11	100	11,195	資本財			
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	16	295	32,965	資本財			
ACTELION LTD-REG	60	84	1,329	148,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	32	44	605	67,589	運輸			
BALOISE HOLDING AG - REG	28	40	476	53,222	保険			
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	18	26	639	71,426	保険			
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.06	0.09	648	72,441	食品・飲料・タバコ			
ARYZTA AG	52	74	282	31,577	食品・飲料・タバコ			
JULIUS BAER GROUP LTD	133	185	729	81,450	各種金融			
SIKA AG-BR	1	1	745	83,236	素材			
TRANSOCEAN LTD	211	—	—	—	エネルギー			
SWISS PRIME SITE-REG	34	55	469	52,402	不動産			
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.55	0.81	491	54,885	食品・飲料・タバコ			

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	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	13	530	59,185	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	211	23,628	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	6	317	35,414	素材
UBS GROUP AG-REG	2,164	3,026	4,688	523,404	各種金融
DUFREY AG-REG	—	33	439	49,023	小売
GALENICA AG-REG	—	3	435	48,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,781 38	13,757 39	87,547 —	9,772,976 <3.6%>
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	140	199	4,585	61,124	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	1,804	2,516	15,592	207,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	234	321	6,042	80,541	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	901	1,254	9,429	125,696	銀行
INVESTOR AB-B SHS	271	375	10,196	135,914	各種金融
NORDEA BANK AB	1,801	2,509	19,198	255,917	銀行
GETINGE AB-B SHS	118	166	2,808	37,434	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	296	1,239	12,777	170,322	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	400	556	11,324	150,954	資本財
SKF AB-B SHARES	233	329	4,787	63,813	資本財
ASSA ABLOY AB-B	198	829	13,665	182,161	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	562	784	20,827	277,636	小売
SANDVIK AB	635	882	7,035	93,789	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	537	749	12,938	172,474	銀行
SECURITAS AB-B SHS	182	259	3,252	43,349	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	348	500	12,647	168,584	家庭用品・パーソナル用品
SKANSKA AB-B SHS	223	313	5,641	75,201	資本財
SWEDISH MATCH AB	120	163	4,440	59,197	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	188	255	1,983	26,445	電気通信サービス
TELIA CO AB	1,536	2,147	8,063	107,485	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS	909	1,274	11,822	157,592	資本財
ALFA LAVAL AB	188	242	3,040	40,529	資本財
ELEKTA AB-B SHS	214	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
LUNDIN PETROLEUM AB	125	179	2,648	35,305	エネルギー
BOLIDEN AB	159	225	3,064	40,855	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	240	355	2,329	31,056	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	38	55	2,484	33,124	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS	150	214	6,676	89,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	140	194	4,291	57,199	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	95	129	1,796	23,942	各種金融
ICA GRUPPEN AB	46	68	1,876	25,016	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,047 31	19,293 30	227,270 —	3,029,520 <1.1%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	580	809	7,980	105,982	銀行
NORSK HYDRO ASA	805	1,105	3,523	46,797	素材
ORKLA ASA	475	669	5,042	66,958	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA	662	924	12,477	165,699	エネルギー
TELENOR ASA	445	621	8,596	114,158	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	105	147	4,314	57,291	素材
SUBSEA 7 SA	166	—	—	—	エネルギー
SEADRILL LTD	233	—	—	—	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	119	170	2,335	31,020	保険

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	64	1,720	22,851	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	76	1,973	26,210	メディア
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,595 9	4,588 9	47,964 —	636,971 <0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	1,189	1,621	58,108	966,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES	142	193	6,093	101,390	素材
DANSKE BANK A/S	388	585	10,730	178,562	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING	12	21	1,401	23,322	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	131	185	8,421	140,137	資本財
TDC A/S	478	675	2,302	38,317	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	63	88	5,494	91,436	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	66	92	4,528	75,349	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	105	160	4,525	75,300	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	4	5	4,926	81,981	運輸
TRYG A/S	13	93	1,160	19,303	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	2	3	2,743	45,643	運輸
PANDORA A/S	68	91	8,649	143,922	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	71	123	3,148	52,392	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	82	3,376	56,181	素材
GENMAB A/S	—	44	4,400	73,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,739 14	4,067 16	130,011 —	2,163,383 <0.8%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BHP BILLITON LIMITED	1,904	2,662	4,939	394,700	素材
CSL LTD	282	385	4,245	339,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	1,564	2,146	284	22,729	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	441	618	1,634	130,642	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,639	2,412	5,893	470,988	銀行
RIO TINTO LTD	258	353	1,626	130,010	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	815	1,147	1,344	107,425	保険
LENLEASE GROUP	329	468	633	50,638	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	963	1,416	11,049	882,944	銀行
WESTPAC BANKING CORP	1,848	2,757	8,633	689,904	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,387	2,180	6,298	503,299	銀行
BRAMBLES LTD	940	1,325	1,734	138,565	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	373	494	168	13,476	運輸
BORAL LTD	466	622	428	34,251	素材
WOOLWORTHS LTD	750	1,057	2,410	192,634	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	2,553	3,585	2,047	163,585	電気通信サービス
AMP LTD	1,763	2,496	1,452	116,100	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	518	692	297	23,798	消費者サービス
AMCOR LIMITED	722	970	1,559	124,595	素材
COMPUTERSHARE LTD	287	403	419	33,556	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	464	487	38,919	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	172	256	1,811	144,769	各種金融
CIMIC GROUP LTD	64	84	318	25,483	資本財
ASX LTD	117	165	742	59,312	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	351	501	460	36,780	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	35	48	563	45,021	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	276	377	743	59,438	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	354	467	218	17,499	小売

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
NEWREST MINING LTD	454	637	1,309	104,632	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,392	2,050	1,240	99,113	保険
ORIGIN ENERGY LTD	664	1,462	743	59,381	エネルギー
ORICA LTD	222	312	426	34,094	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	229	332	678	54,231	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	590	1,400	568	45,443	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	776	1,080	1,390	111,130	保険
TRANSURBAN GROUP	1,097	1,714	2,130	170,279	運輸
WESFARMERS LTD	668	936	4,040	322,915	食品・生活必需品小売り
TOLL HOLDINGS LTD	412	—	—	—	運輸
CHALLENGER LTD	—	485	451	36,102	各種金融
SYDNEY AIRPORT	667	949	693	55,389	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	163	227	766	61,229	エネルギー
OTL SEARCH LTD	—	1,148	774	61,871	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	128	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD	405	582	1,101	87,983	公益事業
TATTS GROUP LTD	891	1,244	491	39,281	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	911	1,276	371	29,678	素材
ASCIANO LTD	585	547	487	38,961	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	251	354	216	17,313	素材
AUSNET SERVICES	1,155	1,718	278	22,250	公益事業
CROWN RESORTS LTD	212	300	361	28,896	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,020	1,427	461	36,841	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	270	400	385	30,789	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	1,304	1,764	802	64,166	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	382	619	634	50,701	食品・飲料・タバコ
ALS LTD	252	—	—	—	商業・専門サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	79	120	836	66,825	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	34	47	185	14,860	消費者サービス
SEEK LTD	190	284	467	37,374	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	228	328	374	29,917	銀行
REA GROUP LTD	33	48	259	20,774	メディア
TPG TELECOM LTD	176	247	286	22,881	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	705	1,457	408	32,609	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,652	2,309	729	58,330	保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	139	195	120	9,600	各種金融
SOUTH32 LTD	—	4,430	717	57,356	素材
VOVOC COMMUNICATIONS LTD	—	390	346	27,705	電気通信サービス
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
銘柄 数 < 比 率 >	39,535	63,400	87,989	7,031,240	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,069	1,518	560	41,480	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	556	803	537	39,803	運輸
CONTACT ENERGY LTD	231	630	333	24,659	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	393	573	492	36,486	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	213	321	298	22,095	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	797	1,118	306	22,697	公益事業
MIGHTY RIVER POWER	452	644	197	14,592	公益事業
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
銘柄 数 < 比 率 >	3,713	5,610	2,726	201,815	
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	900	1,130	4,661	65,117	不動産

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,270	—	—	—	資本財	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	375	490	4,044	56,507	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	820	2,238	20,830	291,007	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,000	1,440	13,140	183,565	不動産	
MTR CORP	875	1,225	4,704	65,714	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	3,782	5,865	8,481	118,492	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,050	4,500	3,244	45,325	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	830	1,165	8,964	125,236	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	658	950	17,651	246,584	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	720	1,020	1,240	17,327	運輸	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,310	1,870	2,655	37,095	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	1,135	1,595	11,643	162,659	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	618	958	4,429	61,874	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	698	990	2,742	38,317	銀行	
HANG SENG BANK LTD	452	632	8,664	121,046	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	380	540	1,738	24,291	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	600	1,080	968	13,533	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	137	209	1,146	16,014	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	1,774	2,514	2,865	40,037	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	435	610	1,726	24,116	耐久消費財・アパレル	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	370	570	4,283	59,841	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,200	3,060	6,854	95,755	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	805	1,150	3,524	49,240	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	2,510	3,530	1,803	25,199	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	3,400	4,900	2,146	29,982	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	395	520	1,011	14,136	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	895	1,285	1,547	21,613	資本財	
SANDS CHINA LTD	1,436	2,008	5,532	77,282	消費者サービス	
WHELOCK & CO LTD	550	750	2,606	36,409	不動産	
WYNN MACAU LTD	904	1,272	1,422	19,866	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	1,150	1,660	790	11,038	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	1,420	2,080	1,002	14,005	各種金融	
AIA GROUP LTD	7,146	9,976	43,345	605,539	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	704	1,004	1,999	27,939	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,370	1,940	4,811	67,212	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	552	852	886	12,378	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,530	2,280	2,576	35,992	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	2,240	4,875	2,949	41,202	食品・飲料・タバコ	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	2,238	10,532	147,145	不動産	
小 計	株 数	51,397	76,974	225,171	3,145,651	
	銘柄 数 < 比 率 >	39	39	—	< 1.2% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,794	2,561	2,133	169,193	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	972	1,344	520	41,266	メディア	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	590	801	213	16,961	資本財	
CAPITALAND LTD	1,530	2,156	642	50,955	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	250	360	289	22,955	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	64	97	330	26,179	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,040	1,461	2,143	169,984	銀行	
KEPPEL CORP LTD	870	1,208	618	49,052	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	773	1,071	1,880	149,156	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	950	1,357	428	34,009	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,762	6,613	2,539	201,417	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	343	479	558	44,294	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	500	671	500	39,699	各種金融	
SEMBCORP MARINE LTD	500	660	100	7,956	資本財	
UOL GROUP LTD	290	391	219	17,396	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,230	1,810	503	39,907	運輸	
NOBLE GROUP LTD	2,710	4,185	146	11,619	資本財	
STARHUB LTD	400	565	187	14,832	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,393	6,110	223	17,689	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,150	1,606	528	41,905	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	3,700	4,988	379	30,065	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,880	2,640	465	36,955	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,150	1,726	155	12,320	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	31,844	44,863	15,707	1,245,773	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	258	406	668	19,270	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	510	755	15,128	436,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOLIM BM	616	877	1,704	49,143	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	34	48	1,179	34,021	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	777	1,161	1,620	46,732	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	—	—	—	素材	
DELEK GROUP LTD	2	3	275	7,956	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,127	1,607	1,301	37,546	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	80	120	517	14,938	銀行	
AZRIELI GROUP	—	31	481	13,874	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,409	5,013	22,877	659,793	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	846,139	1,109,747	—	255,005,772	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,258	1,260	—	<94.4%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	27	38	1,312	142,236	0.1	
MACERICH CO/THE	8	11	866	93,856	0.0	
PROLOGIS INC	29	43	2,034	220,503	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	7	614	66,590	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	12	1,126	122,123	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	5	1,263	136,895	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	9	892	96,716	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	5	894	96,956	0.0	
WELLTOWER INC	20	29	2,080	225,517	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	9	12	1,666	180,583	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	6	634	68,737	0.0	
REALTY INCOME CORP	13	20	1,304	141,409	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	5	7	609	66,059	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	5	8	866	93,880	0.0	
UDR INC	15	21	797	86,464	0.0	
VENTAS INC	19	27	1,806	195,778	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	55	77	856	92,850	0.0	
RAYONIER INC	7	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	30	65	2,022	219,215	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	24	35	3,711	402,162	0.1	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	20	28	536	58,088	0.0	
VEREIT INC	53	75	722	78,319	0.0	
DUKE REALTY CORP	20	28	663	71,873	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	15	409	44,333	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	9	17	648	70,318	0.0	
EQUINIX INC	3	5	1,881	203,869	0.1	
COMMUNICATIONS SALES & LE	7	—	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	—	27	2,490	269,940	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	20	30	2,103	228,007	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	31	47	1,318	142,931	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	44	62	997	108,126	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8	12	448	48,638	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	10	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	8	12	3,155	341,926	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	18	25	5,208	564,481	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	9	14	1,351	146,500	0.1	
KIMCO REALTY CORP	24	34	1,000	108,451	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	11	2,115	229,297	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	592	892	50,416	5,463,644	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	5	181	15,299	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	11	240	20,250	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	13	370	31,252	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	29	792	66,802	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	2	359	44,485	0.0
KLEPIERRE		10	18	744	92,180	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		5	8	1,913	236,890	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	2	202	25,025	0.0
ICADE		2	2	186	23,084	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	21	34	3,405	421,666	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		57	80	583	91,374	0.0
HAMMERSON PLC		46	65	377	59,117	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		46	65	752	117,785	0.0
INTU PROPERTIES PLC		54	78	229	35,967	0.0
SEGRO PLC		44	62	262	41,163	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	249	351	2,206	345,408	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		90	285	976	78,011	0.0
SCENTRE GROUP		316	446	2,054	164,143	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		132	—	—	—	—
GPT GROUP		102	153	800	63,994	0.0
MIRVAC GROUP		226	317	620	49,577	0.0
STOCKLAND		141	202	929	74,289	0.0
WESTFIELD CORP		117	165	1,779	142,238	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP		57	83	711	56,893	0.0
GOODMAN GROUP		104	149	1,082	86,470	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,289	1,803	8,955	715,618	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 0.3% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		135	186	8,653	120,890	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	135	186	8,653	120,890	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		143	211	349	27,703	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		131	172	240	19,107	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		146	215	446	35,411	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		122	183	446	35,441	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	542	784	1,483	117,664	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,847	4,083	—	7,251,695	
	銘柄 数 < 比 率 >	60	61	—	< 2.7% >	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP EMINI	4,951	—
		SP/TSE60	297	—
		SWISS IX	281	—
		EURO ST	1,165	—
		SPI 200	299	—
		FTSE100	594	—

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 255,005,772	% 94.4
投資証券	7,251,695	2.7
コール・ローン等、その他	7,907,174	2.9
投資信託財産総額	270,164,641	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(269,579,000千円)の投資信託財産総額(270,164,641千円)に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 ユーロ=123.81円	1 イギリスポンド=156.52円
1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=79.91円	1 ニュージーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円
1 イスラエルシェゲル=28.84円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	270,567,377,983
コール・ローン等	5,990,555,724
株式(評価額)	255,005,772,397
投資証券(評価額)	7,251,695,005
未収入金	448,779,016
未収配当金	509,853,785
差入委託証拠金	1,360,722,056
(B) 負債	501,616,589
未払金	489,693,779
未払解約金	11,915,982
未払利息	986
その他未払費用	5,842
(C) 純資産総額(A-B)	270,065,761,394
元本	136,910,588,935
次期繰越損益金	133,155,172,459
(D) 受益権総口数	136,910,588,935口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,726円

<注記事項>

- ①期首元本額 98,648,858,071円
 期中追加設定元本額 105,675,196,642円
 期中一部解約元本額 67,413,465,778円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9726円です。

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,144,972,744
受取配当金	5,114,973,722
受取利息	605,578
その他収益金	32,650,193
支払利息	△ 3,256,749
(B) 有価証券売買損益	△ 39,922,483,936
売買益	14,666,285,344
売買損	△ 54,588,769,280
(C) 先物取引等取引損益	△ 413,189,353
取引益	1,107,317,888
取引損	△ 1,520,507,241
(D) 保管費用等	△ 120,160,518
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 35,310,861,063
(F) 前期繰越損益金	128,865,980,554
(G) 追加信託差損益金	118,154,658,797
(H) 解約差損益金	△ 78,554,605,829
(I) 計(E+F+G+H)	133,155,172,459
次期繰越損益金(I)	133,155,172,459

- (注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）	
ファンド・マネジャー（海外株式）	2,448,719,365円
eMAXIS 先進国株式インデックス	16,378,104,804円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,138,768,930円
eMAXIS バランス（波乗り型）	120,737,094円
コアバランス	219,720円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	5,850,610,646円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,408,019,604円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	823,810,399円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,882,465,423円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	85,978,515円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	16,118,943,652円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	16,679,805,595円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	347,095,316円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	2,909,896,008円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	46,542,204,119円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	271,114,613円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	119,808,786円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,054,265,694円
MSCI コクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	3,180,423,248円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	52,918,604円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6,872,839,069円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,903,425,272円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	7,173,466円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	22,285,032円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	51,267,580円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	47,118,237円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	166,480,868円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	36,705,073円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	291,823,087円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	65,215,077円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	523,982,813円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,096,664,594円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	196,823,527円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	767,070,036円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	695,163,101円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	581,896,994円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	530,050,843円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	416,410,090円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	92,997,552円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	13,474,781円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	59,237円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	85,793円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	102,421円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	15,891,218円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	464,062円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	3,556,879円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	1,527,502円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）	4,840,689円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	2,003,954円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	89,261,136円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	18,817円
合計	136,910,588,935円

【お 知 ら せ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限について、買付基準の記載部分の「取得時において」の削除を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年12月2日)
- ③信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)