

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
信託期間	2027年2月5日まで（2017年3月27日設定）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として海外株式に実質的な投資を行います。投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。投資信託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を行いません。 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
主要運用対象	別に示した投資対象ファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

海外株式セレクション （ラップ向け）

第1期（決算日：2018年2月5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「海外株式セレクション（ラップ向け）」は、去る2月5日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) 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 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率				
(設定日)	円	円	%			%	%	%	百万円
2017年3月27日	10,000	—	—		205,394.43	—	—	—	10
1期(2018年2月5日)	11,655	0	16.6		239,902.14	16.8	92.7	1.8	3,853

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(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 (MSCIコクサイインデックス) (円換算ベース) は、MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス) (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 (MSCIコクサイインデックス) に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(参 考 指 数) 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 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(設定日) 2017年3月27日	円 10,000	% —		% —	% —	% —	% —
3月末	10,199	2.0	210,645.59	2.6	93.5	2.5	2.0
4月末	10,285	2.9	211,426.63	2.9	93.6	3.7	2.0
5月末	10,447	4.5	213,893.04	4.1	90.5	2.0	1.8
6月末	10,613	6.1	216,771.74	5.5	91.1	2.1	1.9
7月末	10,690	6.9	218,312.80	6.3	93.3	1.8	2.0
8月末	10,674	6.7	217,004.23	5.7	91.6	3.7	2.0
9月末	11,089	10.9	226,693.38	10.4	92.7	2.8	1.9
10月末	11,318	13.2	231,677.67	12.8	93.4	2.7	1.9
11月末	11,384	13.8	232,888.87	13.4	92.6	2.2	1.9
12月末	11,696	17.0	239,758.54	16.7	92.4	2.3	1.9
2018年1月末	11,721	17.2	242,304.49	18.0	93.8	0.9	1.8
(期 末) 2018年2月5日	11,655	16.6	239,902.14	16.8	92.7	1.5	1.8

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第1期：2017/3/27～2018/2/5）

基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ16.6%の上昇となりました。



- ・分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。



実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

すべての組入れファンドが上昇し、プラスに寄与しました。

投資環境について

（第1期：2017/3/27～2018/2/5）

◎海外株式市況

- ・海外株式市況は上昇しました。
- ・設定後、北朝鮮をめぐる地政学リスクが高まったことやトランプ米政権の政策運営をめぐる不透明感などから、上値が抑えられる場面があったものの、底堅い企業業績や米連邦準備制度理事会（FRB）が追加利上げに慎重な姿勢を示したこと、米税制改革法案の可決を受けて設備投資や個人投資などのさらなる拡大への期待などから上昇し、結果として海外株式市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドルは、日米の金利差拡大が円安・米ドル高要因となった一方で、米国における政治的不透明感の高まりや北朝鮮を巡る地政学的リスクの高まりなどが円高・米ドル安要因となった結果、期を通じてみると米ドルは円に対して下落しました。
- ・ユーロは、欧州中央銀行（ECB）による金融緩和縮小観測の高まりなどから円に対して上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

i 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

- ・投資信託証券への投資を通じて、主として海外株式に実質的な投資を行いました。
- ・投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき行い、期を通じて「外国株式インデックスマザーファンド」、「新興国株式インデックスマザーファンド」、「アセアン真成長株式マザーファンド」、「好配当海外株マザーファンド」、「AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド」に投資を行いました。
- ・前記の運用の結果、すべての組入れファンドが上昇したことなどから、基準価額は設定時に比べて上昇しました。

（ご参考）投資信託証券別組入比率表

（%）

投資信託証券	設定時	2017年 3月末	4月末	5月末	6月末	7月末	8月末	9月末	10月末	11月末	12月末	2018年 1月末
外国株式インデックスマザーファンド	—	60.21	60.13	58.57	58.53	59.38	59.65	60.11	59.61	59.73	59.68	59.55
新興国株式インデックスマザーファンド	—	1.98	1.98	1.98	1.91	2.02	2.06	2.01	1.95	1.94	1.88	1.97
アセアン真成長株式マザーファンド	—	1.99	2.01	1.92	1.92	1.97	1.99	2.01	2.12	2.10	2.05	1.94
好配当海外株マザーファンド	—	29.59	29.67	29.17	28.96	29.50	29.45	29.21	29.26	29.09	29.22	29.24
AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド	—	4.87	4.90	4.77	4.77	4.94	4.92	4.85	4.87	4.78	4.80	4.57

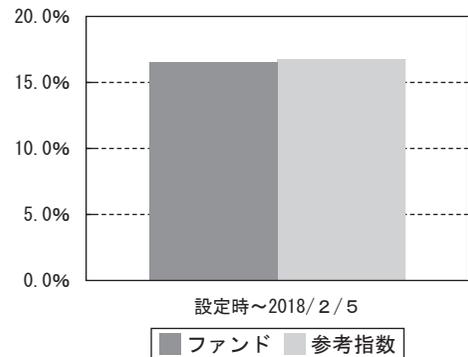
（注）比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

i ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。右記のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
- ・参考指数はMSCI Kokusai Index（MSCI コクサイ インデックス）（円換算ベース）です。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



分配金について

i 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額的水準等を勘案し、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1期
	2017年3月27日～2018年2月5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	1,655

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

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

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

◎今後の運用方針

- ・海外株式を実質的な主要投資対象とし、主として値上がり益の獲得をめざします。
- ・投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

○ 1万口当たりの費用明細

（2017年3月27日～2018年2月5日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	58 (49) (4) (4)	0.530 (0.453) (0.039) (0.039)	(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) 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 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 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 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	9 (9) (0) (0) (0)	0.085 (0.082) (0.000) (0.001) (0.002)	(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
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	3 (3) (0) (0)	0.024 (0.024) (0.000) (0.000)	(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
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他)	9 (8) (0) (1)	0.084 (0.076) (0.003) (0.005)	(d) 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 ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	79	0.723	
期中の平均基準価額は、10,919円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2017年3月27日～2018年2月5日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
好配当海外株マザーファンド	846,107	1,090,880	44,883	62,240
新興国株式インデックスマザーファンド	29,357	65,950	2,204	5,700
アセアン真成長株式マザーファンド	65,531	66,770	5,307	6,580
AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド	162,914	189,410	—	—
外国株式インデックスマザーファンド	922,732	2,202,960	84,412	219,490

○株式売買比率

(2017年3月27日～2018年2月5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				
	好配当海外株マザーファンド	新興国株式インデックスマザーファンド	アセアン真成長株式マザーファンド	AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド	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	6,900,423千円	15,551,300千円	3,620,439千円	665,962千円	236,633,392千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,447,232千円	53,871,380千円	1,327,825千円	749,274千円	345,328,659千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.26	0.28	2.72	0.88	0.68

(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

(2017年3月27日～2018年2月5日)

利害関係人との取引状況

<海外株式セレクション（ラップ向け）>

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			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 194,143	百万円 29,357	% 15.1	百万円 190,643	百万円 78,730	% 41.3

平均保有割合 0.5%

※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。

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	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 18,796	百万円 1,555	% 8.3	百万円 6,037	百万円 511	% 8.5

平均保有割合 0.1%

※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。

＜アセアン真成長株式マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 2,504	百万円 113	% 4.5	百万円 1,116	百万円 73	% 6.5

平均保有割合 3.9%

※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。

＜好配当海外株マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 1,783	百万円 277	% 15.5	百万円 5,116	百万円 395	% 7.7
為替直物取引	3,544	407	11.5	7,029	1,767	25.1

平均保有割合 15.4%

※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。

＜AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	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 601	百万円 7	% 1.2	百万円 658	百万円 12	% 1.8

平均保有割合 16.2%

※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。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	2,391千円
うち利害関係人への支払額 (B)	186千円
(B) / (A)	7.8%

(注) 売買委託手数料総額は、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です。

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券、三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2017年3月27日～2018年2月5日)

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 10	百万円 —	百万円 —	百万円 10	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2018年2月5日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
好配当海外株マザーファンド		801,223	1,141,983
新興国株式インデックスマザーファンド		27,153	75,523
アセアン真成長株式マザーファンド		60,223	75,628
AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド		162,914	189,665
外国株式インデックスマザーファンド		838,319	2,276,792

○投資信託財産の構成

(2018年2月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
好配当海外株マザーファンド	1,141,983	29.5
新興国株式インデックスマザーファンド	75,523	2.0
アセアン真成長株式マザーファンド	75,628	2.0
AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド	189,665	4.9
外国株式インデックスマザーファンド	2,276,792	58.8
コール・ローン等、その他	109,527	2.8
投資信託財産総額	3,869,118	100.0

(注) 好配当海外株マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（3,923,015千円）の投資信託財産総額（3,966,812千円）に対する比率は98.9%です。

(注) 新興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（72,513,381千円）の投資信託財産総額（73,353,781千円）に対する比率は98.9%です。

(注) アセアン真成長株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（2,705,984千円）の投資信託財産総額（2,791,042千円）に対する比率は97.0%です。

(注) AMP グローバル・インフラ株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（821,691千円）の投資信託財産総額（851,113千円）に対する比率は96.5%です。

(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（405,208,667千円）の投資信託財産総額（406,031,339千円）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相場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=109.90円	1 カナダドル=88.49円	1 メキシコペソ=5.91円	1 ブラジルリアル=34.13円
100チリペソ=18.22円	100コロンビアペソ=3.87円	1 ユーロ=136.78円	1 イギリスポンド=155.15円
1 スイスフラン=118.03円	1 スウェーデンクローネ=13.88円	1 ノルウェークローネ=14.17円	1 デンマーククローネ=18.38円
1 トルコリラ=29.15円	1 チェココ罗纳=5.42円	100ハンガリーフォリント=44.18円	1 ポーランドズロチ=32.82円
1 オーストラリアドル=87.04円	1 ニュージーランドドル=80.24円	1 香港ドル=14.05円	1 シンガポールドル=83.25円
1 マレーシアリングギット=28.20円	1 タイバーツ=3.49円	1 フィリピンペソ=2.13円	100インドネシアルピア=0.82円
100韓国ウォン=10.09円	1 ニュー台湾ドル=3.76円	1 インドルピー=1.73円	100ベトナムドン=0.48円
1 アラブディルハム=29.97円	1 イスラエルシェケル=31.85円	1 カタールリアル=30.24円	1 南アフリカランド=9.12円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年2月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,869,118,456
コール・ローン等	109,524,749
好配当海外株マザーファンド(評価額)	1,141,983,322
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	75,523,283
アセアン真成長株式マザーファンド(評価額)	75,628,917
AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド(評価額)	189,665,346
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	2,276,792,839
(B) 負債	15,691,618
未払解約金	7,625,110
未払信託報酬	8,021,175
未払利息	167
その他未払費用	45,166
(C) 純資産総額(A-B)	3,853,426,838
元本	3,306,164,003
次期繰越損益金	547,262,835
(D) 受益権総口数	3,306,164,003口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,655円

<注記事項>

- ①設定元本額 10,000,000円
 期中追加設定元本額 4,047,047,119円
 期中一部解約元本額 750,883,116円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1655円です。

②分配金の計算過程

項 目	2017年3月27日～ 2018年2月5日
費用控除後の配当等収益額	59,179,718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	307,733,847円
収益調整金額	180,349,270円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	547,262,835円
1万口当たり収益分配対象額	1,655円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

- ③「AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の50以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○損益の状況（2017年3月27日～2018年2月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 35,288
受取利息	488
支払利息	△ 35,776
(B) 有価証券売買損益	382,005,614
売買益	437,464,863
売買損	△ 55,459,249
(C) 信託報酬等	△ 15,056,761
(D) 当期損益金(A+B+C)	366,913,565
(E) 追加信託差損益金	180,349,270
(配当等相当額)	(△ 13,436)
(売買損益相当額)	(180,362,706)
(F) 計(D+E)	547,262,835
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	547,262,835
追加信託差損益金	180,349,270
(配当等相当額)	(9,178,483)
(売買損益相当額)	(171,170,787)
分配準備積立金	366,913,565

- (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) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

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

【お 知 ら せ】

- ①当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

外国株式インデックスマザーファンド

《第16期》決算日2017年5月12日

[計算期間：2016年5月13日～2017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16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16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 額
	期 騰 落	中 率	(円換算ベース)	期 騰 落				
	円	%			%	%	%	百万円
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
16期(2017年5月12日)	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4	332,985

(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		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) 2016年5月12日	19,726	—	135.59	—	94.4	2.8	2.7
5月末	20,571	4.3	140.96	4.0	95.5	1.8	2.7
6月末	18,592	△ 5.7	127.30	△ 6.1	93.7	4.9	2.8
7月末	19,767	0.2	135.16	△ 0.3	94.0	2.6	2.8
8月末	19,706	△ 0.1	134.53	△ 0.8	94.8	3.1	2.7
9月末	19,237	△ 2.5	131.19	△ 3.2	94.0	3.2	2.7
10月末	19,636	△ 0.5	133.57	△ 1.5	95.9	2.0	2.6
11月末	21,454	8.8	145.64	7.4	96.0	1.1	2.5
12月末	22,809	15.6	154.51	14.0	93.2	1.1	2.5
2017年1月末	22,737	15.3	154.07	13.6	93.3	4.2	2.4
2月末	23,181	17.5	156.94	15.7	94.9	2.6	2.5
3月末	23,408	18.7	158.11	16.6	93.7	3.8	2.4
4月末	23,574	19.5	158.70	17.0	94.2	6.0	2.5
(期 末) 2017年5月12日	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4

(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

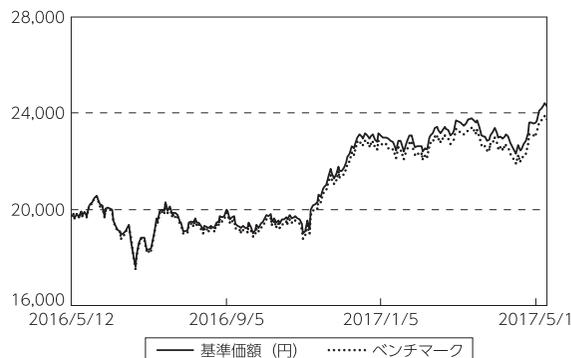
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ23.2%の上昇となりました。

◎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(20.4%)を2.8%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

- ・米国の堅調な企業決算発表や米国大統領選挙結果を受けた今後の政策期待などから、外国株式市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて5.1%の円安・米ドル高、ユーロは円に対してほぼ横ばいとなりました。

●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・不動産投資信託証券 (REIT) を含む) を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

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

- 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20.4%の上昇となったため、カイ離は2.8%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	△0.1%程度	2.9%程度	2.8%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△0.1%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2.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計 3.0%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。

◎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

(2016年5月13日～2017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)	(0.006)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	6	0.028	(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)	(6)	(0.027)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	8	0.039	(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)	(8)	(0.038)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	18	0.084	
期中の平均基準価額は、21,222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	デンマーク	百株 2,544 (84)	千デンマーククローネ 75,217 (-)	百株 2,430	千デンマーククローネ 72,714
	オーストラリア	36,284 (334)	千オーストラリアドル 53,043 (-)	36,080 (513)	千オーストラリアドル 51,712 (456)
	ニュージーランド	2,010	千ニュージーランドドル 1,023	1,858	千ニュージーランドドル 927
国	香港	46,613 (712)	千香港ドル 140,613 (-)	42,212	千香港ドル 139,624
	シンガポール	24,661 (4,185)	千シンガポールドル 10,211 (-)	28,234 (4,185)	千シンガポールドル 9,967 (33)
	イスラエル	2,463	千イスラエルシェケル 9,045	2,802	千イスラエルシェケル 19,434

(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	684	20	670
MACERICH CO/THE	6	467	7	520
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10	1,082	4	447
PROLOGIS INC	23	1,202	22	1,145
CAMDEN PROPERTY TRUST	3	329	3	308
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16	710	4	197
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	811	6	724
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	710	3	714
EXTRA SPACE STORAGE INC	7	605	6	515
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	571	3	552
WELLTOWER INC	16	1,182	15	1,115
BOSTON PROPERTIES INC	7	931	6	902
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7	725	4	455
REALTY INCOME CORP	12	779	11	735
REGENCY CENTERS CORP	11	783	6	452
SL GREEN REALTY CORP	5	541	4	520
UDR INC	15	549	15	546
VENTAS INC	17	1,130	15	994
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	65	711	57	624
WEYERHAEUSER CO	33	1,093	36	1,151
AMERICAN TOWER CORP	19	2,172	18	2,167
AGNC INVESTMENT CORP	16	319	16	325
VEREIT INC	60	557	52	473
DUKE REALTY CORP	19	495	18	491
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24	615	14	331
IRON MOUNTAIN INC	16	602	13	485
EQUINIX INC	3	1,386	2	1,093
CROWN CASTLE INTL CORP	17	1,639	15	1,412
QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	7	98
	(7)	(—)		
PARK HOTELS & RESORTS INC	—	—	11	331
	(11)	(277)		
EQUITY RESIDENTIAL	16	1,087	16	1,031
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	61	886	16	220
GGP INC	25	663	25	645
HOST HOTELS & RESORTS INC	34	620	35	622
LIBERTY PROPERTY TRUST	7	295	7	286
PUBLIC STORAGE	6	1,530	6	1,470
SIMON PROPERTY GROUP INC	14	2,679	13	2,500
VORNADO REALTY TRUST	7	798	7	778
KIMCO REALTY CORP	21	561	19	494

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	1,104	5	1,070
小 計	680 (19)	33,618 (277)	583	29,628
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4	139	3	127
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4	102	3	79
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4	129	4	120
小 計	13	371	11	327
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	2	314	1	228
KLEPIERRE	10	388	10	395
UNIBAIL-RODAMCO SE	4	1,030	4	981
FONCIERE DES REGIONS	1 (-)	122 (△ 2)	1	114
ICADE	1	97	1	69
小 計	20 (-)	1,953 (△ 2)	19	1,789
ユ ー ロ 計	20 (-)	1,953 (△ 2)	19	1,789
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	54	353	52	327
HAMMERSON PLC	39	226	37	211
LAND SECURITIES GROUP PLC	40	436	41	432
INTU PROPERTIES PLC	46	133	42	118
SEGRO PLC	52	240	30	138
SEGRO PLC -RTS	- (15)	- (-)	15	14
小 計	234 (15)	1,390 (-)	220	1,244
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	162	493	156	466
SCENTRE GROUP	243	1,098	236	1,059
GPT GROUP	82	424	88	458
MIRVAC GROUP	200	429	214	467
STOCKLAND	139	640	131	608
WESTFIELD CORP	92	872	91	858
DEXUS	46	435	45	432
GOODMAN GROUP	91	665	90	679
小 計	1,059	5,060	1,056	5,031
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	108	5,716	105	5,647
小 計	108	5,716	105	5,647

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
	SUNTEC REIT	94 (-)	163 (△ 1)	88	155
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	118	178	106	160
	CAPITALAND MALL TRUST	116	232	113	227
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	105 (-)	257 (△ 1)	94	237
小計		435 (-)	832 (△ 3)	403	781

(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 247,123	百万円 250,771	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

(2016年5月13日～2017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	322,887,241千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	286,537,329千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.12

(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

(2016年5月13日～2017年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 261,252	百万円 90,463	% 34.6	百万円 268,893	百万円 180,086	% 67.0

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

(2017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	1,083	—	—	—	素材
AMERICAN EXPRESS CO	692	653	5,088	579,835	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	1,233	1,444	6,335	721,910	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	274	274	1,544	176,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	44	46	713	81,276	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	381	379	3,659	416,930	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	58	61	246	28,125	小売
AES CORP	566	549	630	71,830	公益事業
AFLAC INC	352	342	2,532	288,523	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,022	861	5,325	606,800	保険
APACHE CORP	313	319	1,629	185,687	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	—	671	742	84,634	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	50	44	1,104	125,885	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	516	520	6,287	716,441	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	169	173	2,489	283,702	素材
ANTHEM INC	215	221	4,041	460,539	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	421	469	2,421	275,906	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,112	1,144	3,018	343,939	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	472	411	2,318	264,191	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	526	492	9,057	1,031,957	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	174	178	3,300	376,078	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	256	238	1,238	141,114	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,380	1,403	7,736	881,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	101	101	3,902	444,705	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,367	3,420	15,741	1,793,634	電気通信サービス
CR BARD INC	61	61	1,905	217,087	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	108	142	1,140	129,918	素材
BAKER HUGHES INC	361	337	2,001	228,077	エネルギー
ALLSTATE CORP	319	309	2,594	295,617	保険
AVERY DENNISON CORP	75	75	632	72,012	素材
CHUBB LTD	380	389	5,349	609,573	保険
ANALOG DEVICES INC	258	306	2,402	273,691	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	25	24	1,692	192,899	小売
CVS HEALTH CORP	916	894	7,360	838,620	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	178	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	978	801	2,307	262,947	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	3,045	3,001	26,163	2,981,090	銀行
CIGNA CORP	212	215	3,531	402,338	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	481	491	4,966	565,915	資本財
COCA-COLA CO/THE	3,417	3,436	15,009	1,710,128	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	440	405	3,251	370,488	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	153	165	952	108,534	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	807	787	4,103	467,567	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	166	—	—	—	メディア
CHEVRON CORP	1,557	1,584	16,826	1,917,190	エネルギー
COACH INC	229	237	1,085	123,634	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	108	135	1,411	160,834	資本財
CONOCOPHILLIPS	1,022	1,039	4,930	561,796	エネルギー
CME GROUP INC	265	284	3,326	378,984	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	271	269	1,960	223,326	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	705	709	5,083	579,248	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	495	528	4,101	467,337	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	930	941	5,821	663,268	素材
DEVON ENERGY CORP	381	396	1,504	171,473	エネルギー
DEERE & CO	258	225	2,555	291,181	資本財
DANAHER CORP	509	522	4,326	492,932	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	724	729	5,761	656,435	素材
WALT DISNEY CO/THE	1,299	1,268	13,898	1,583,591	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	94	95	844	96,265	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	571	579	4,813	548,403	公益事業
DR HORTON INC	280	293	975	111,166	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	74	69	350	39,956	小売
TARGET CORP	483	448	2,513	286,439	小売
DUN & BRADSTREET CORP	29	29	326	37,194	商業・専門サービス
DAVITA INC	140	132	889	101,304	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	128	129	1,030	117,424	資本財
DTE ENERGY COMPANY	150	153	1,603	182,685	公益事業
EXXON MOBIL CORP	3,444	3,479	28,745	3,275,230	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	178	179	1,982	225,850	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	455	483	4,557	519,248	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	541	540	3,144	358,268	資本財
EXELON CORP	763	778	2,609	297,339	公益事業
ECOLAB INC	219	220	2,797	318,696	素材
EQUIFAX INC	98	100	1,361	155,146	商業・専門サービス
EMC CORP/MA	1,603	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	183	187	1,738	198,119	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	382	379	2,926	333,492	資本財
EDISON INTERNATIONAL	271	276	2,168	247,091	公益事業
ENTERGY CORP	149	152	1,146	130,644	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	35	34	848	96,692	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	49	46	337	38,467	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	382	393	5,292	603,050	公益事業
MACY'S INC	260	250	608	69,366	小売
FEDEX CORP	222	212	4,048	461,262	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	189	—	—	—	エネルギー
FORD MOTOR CO	3,065	3,120	3,435	391,495	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	322	309	1,338	152,543	各種金融
FOOT LOCKER INC	114	109	830	94,618	小売
FIRSTENERGY CORP	353	357	1,029	117,307	公益事業
FLUOR CORP	117	118	565	64,390	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	957	1,083	1,265	144,226	素材
GENERAL MILLS INC	494	497	2,800	319,083	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	222	217	4,237	482,865	資本財
WW GRAINGER INC	46	46	877	99,933	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	7,808	7,422	21,428	2,441,516	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	111	128	1,132	128,998	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	124	123	1,134	129,310	小売
TEGNA INC	174	173	401	45,693	メディア

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	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	222	214	757	86,273	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	200	201	520	59,280	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	317	300	6,759	770,144	各種金融
HALLIBURTON CO	708	725	3,310	377,235	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	605	607	8,012	912,992	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	159	146	812	92,600	自動車・自動車部品
HP INC	1,487	1,439	2,773	316,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	338	317	1,574	179,441	保険
HERSHEY CO/THE	122	120	1,285	146,424	食品・飲料・タバコ
HARMAN INTERNATIONAL	58	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	1,048	1,022	15,971	1,819,787	小売
HASBRO INC	92	93	945	107,784	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	215	217	1,926	219,559	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	762	757	11,417	1,300,957	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	325	329	1,733	197,481	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	270	265	3,669	418,109	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	336	326	800	91,157	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	66	65	854	97,370	素材
JOHNSON & JOHNSON	2,288	2,282	28,126	3,204,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	535	—	—	—	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	90	88	805	91,735	運輸
KELLOGG CO	219	222	1,571	179,098	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	300	301	3,860	439,919	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,314	1,296	5,790	659,792	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	765	753	2,293	261,343	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	160	153	569	64,848	小売
ELI LILLY & CO	825	834	6,693	762,609	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	83	85	1,212	138,194	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	137	128	747	85,223	運輸
LENNAR CORP-A	148	167	856	97,546	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	758	730	6,188	705,081	小売
LEGGETT & PLATT INC	112	113	604	68,826	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	204	201	1,026	116,908	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	329	367	2,110	240,503	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	228	221	6,027	686,816	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	204	193	1,309	149,226	保険
L3 TECHNOLOGIES INC	64	64	1,078	122,923	資本財
LEGG MASON INC	82	—	—	—	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	170	279	2,870	327,056	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	759	697	10,053	1,145,457	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	223	218	2,996	341,450	各種金融
MEDTRONIC PLC	1,169	1,168	9,702	1,105,526	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	2,310	2,314	14,909	1,698,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	899	875	2,540	289,441	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	280	278	625	71,232	耐久消費財・アパレル
3M CO	509	504	9,928	1,131,196	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	132	124	1,064	121,253	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	373	382	1,183	134,868	消費者サービス
MASCO CORP	279	274	1,004	114,478	資本財
MONSANTO CO	363	367	4,263	485,793	素材
M & T BANK CORP	118	117	1,858	211,798	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	431	433	3,190	363,541	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	
MOHAWK INDUSTRIES INC	52	52	1,233	140,566	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	1,201	1,180	5,061	576,740	各種金融
MCKESSON CORP	190	189	2,767	315,287	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	781	784	4,046	461,062	保険
MANPOWERGROUP INC	60	57	591	67,404	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	147	145	1,680	191,502	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	247	245	2,865	326,440	運輸
BANK OF AMERICA CORP	8,614	8,478	20,408	2,325,324	銀行
NISOURCE INC	—	280	677	77,204	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	143	140	3,484	397,005	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	402	415	542	61,763	銀行
NEWMONT MINING CORP	437	447	1,498	170,719	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	966	889	2,535	288,906	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	96	94	946	107,841	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	11	11	1,119	127,561	保険
NUCOR CORP	264	267	1,540	175,515	素材
NEWELL BRANDS INC	367	366	1,958	223,134	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	366	368	1,044	119,003	メディア
NOBLE ENERGY INC	355	390	1,222	139,335	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	632	642	3,925	447,224	エネルギー
OMNICOM GROUP	200	199	1,672	190,547	メディア
PEPSICO INC	1,205	1,203	13,602	1,549,888	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	80	79	818	93,281	素材
ALTRIA GROUP INC	1,622	1,635	11,530	1,313,732	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	94	93	791	90,143	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,249	2,144	18,479	2,105,524	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	419	408	4,968	566,133	銀行
PFIZER INC	5,106	5,092	16,824	1,916,949	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	371	361	3,892	443,476	保険
PULTEGROUP INC	260	253	582	66,388	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	112	112	1,790	204,011	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	133	142	2,439	277,967	エネルギー
CITIGROUP INC	2,465	2,390	14,513	1,653,618	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	242	241	1,533	174,760	保険
PPG INDUSTRIES INC	222	222	2,387	272,061	素材
PENTAIR PLC	149	146	953	108,621	資本財
PRAXAIR INC	235	240	3,100	353,254	素材
P G & E CORP	408	427	2,814	320,731	公益事業
PPL CORP	560	576	2,221	253,129	公益事業
PROGRESSIVE CORP	482	488	1,965	223,896	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	421	429	1,835	209,124	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS	145	—	—	—	消費者サービス
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	145	144	1,563	178,144	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	248	246	3,920	446,645	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	200	201	1,277	145,508	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,078	1,037	1,470	167,596	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	36	34	470	53,582	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	83	85	1,910	217,699	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	345	345	948	108,073	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	109	109	518	59,125	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	109	108	1,694	193,072	資本財
SCHLUMBERGER LTD	1,152	1,166	8,369	953,650	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STRYKER CORP	279	282	3,815	434,730	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	980	1,002	4,011	457,064	各種金融
SEMPRA ENERGY	196	201	2,239	255,122	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	65	66	2,222	253,252	素材
ST JUDE MEDICAL INC	234	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	123	127	1,759	200,433	資本財
SUNTRUST BANKS INC	420	412	2,348	267,633	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	251	238	2,871	327,137	保険
SOUTHERN CO/THE	755	826	4,114	468,770	公益事業
AT&T INC	5,089	5,150	19,798	2,255,817	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	189	240	2,153	245,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	333	324	2,686	306,129	各種金融
SYSCO CORP	466	436	2,403	273,804	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	163	158	684	77,988	素材
SCANA CORP	114	113	746	85,028	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	839	838	6,743	768,323	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	106	103	948	108,108	小売
TORCHMARK CORP	101	96	728	83,015	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	349	787	3,299	375,986	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	330	332	5,678	647,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	226	224	1,089	124,106	資本財
UNION PACIFIC CORP	706	691	7,614	867,597	運輸
UNUM GROUP	201	192	889	101,369	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	696	656	7,961	907,124	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	788	807	13,997	1,594,914	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,446	1,424	7,356	838,232	銀行
MARATHON OIL CORP	682	701	1,015	115,679	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	576	579	6,030	687,126	運輸
VALERO ENERGY CORP	398	380	2,527	287,964	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	80	79	769	87,659	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	—	62	696	79,331	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	359	330	2,074	236,413	メディア
VF CORP	282	279	1,531	174,521	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	110	111	1,433	163,289	素材
WILLIAMS COS INC	590	686	2,079	236,940	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	720	772	6,602	752,257	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	264	268	1,625	185,208	公益事業
WAL-MART STORES INC	1,325	1,296	9,868	1,124,399	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	4,013	4,002	21,509	2,450,778	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	369	372	2,699	307,574	商業・専門サービス
WATERS CORP	67	68	1,177	134,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	731	796	407	46,476	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	64	62	1,160	132,227	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	754	733	519	59,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XL GROUP PLC	244	—	—	—	保険
XCEL ENERGY INC	424	431	1,947	221,949	公益事業
KEYCORP	684	910	1,660	189,232	銀行
CARMAX INC	168	158	938	106,948	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	156	168	2,039	232,413	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	139	132	495	56,413	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	356	294	2,034	231,771	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	553	547	4,350	495,696	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	
CA INC	271	258	828	94,387	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	106	108	1,435	163,528	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	121	118	1,020	116,322	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	—	238	785	89,461	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	341	293	1,821	207,486	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	233	263	2,199	250,584	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	358	347	1,302	148,417	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	244	258	2,053	233,928	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	656	635	1,553	176,956	銀行
STERICYCLE INC	70	72	616	70,228	商業・専門サービス
INTEL CORP	3,903	3,974	14,184	1,616,237	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	4,199	4,212	14,167	1,614,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	75	69	850	96,939	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	105	103	1,327	151,243	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	361	366	6,279	715,477	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	993	908	3,948	449,922	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	257	253	2,755	313,954	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	244	244	1,419	161,730	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	558	525	1,653	188,429	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	337	333	2,177	248,112	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	177	182	1,445	164,707	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	1,121	1,122	6,085	693,414	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	6	12	140	15,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	624	624	9,990	1,138,364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	145	147	1,044	118,984	銀行
NORTHERN TRUST CORP	181	180	1,634	186,237	各種金融
MICROSOFT CORP	6,278	6,198	42,433	4,834,911	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	73	73	884	100,799	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	140	142	1,083	123,482	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	538	549	518	59,088	小売
STARBUCKS CORP	1,227	1,221	7,359	838,494	消費者サービス
ORACLE CORP	2,646	2,583	11,665	1,329,193	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	282	263	975	111,121	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	336	360	5,712	650,883	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	81	79	2,038	232,290	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	423	499	2,787	317,588	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	158	156	1,604	182,771	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	68	67	1,183	134,904	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	111	111	672	76,590	小売
LAM RESEARCH CORP	130	137	2,055	234,226	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	67	67	823	93,853	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	2,054	3,999	15,702	1,789,112	メディア
XILINX INC	212	211	1,366	155,729	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	292	295	1,903	216,897	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	199	192	1,209	137,808	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	60	824	93,973	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,192	1,105	7,372	840,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	127	129	1,131	128,890	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	30	32	2,751	313,459	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	207	205	2,604	296,810	ソフトウェア・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	205	234	448	51,107	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	268	273	1,565	178,316	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	
YAHOO! INC	741	762	3,788	431,702	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	72	73	317	36,211	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	42	45	634	72,323	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	57	109	1,152	131,298	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	187	167	1,602	182,600	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	208	208	630	71,885	メディア
SALESFORCE.COM INC	522	541	4,753	541,557	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	114	110	512	58,380	小売
ALPHABET INC-CL A	240	248	23,752	2,706,406	ソフトウェア・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	37	35	439	50,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	87	—	—	—	資本財
GARMIN LTD	94	100	526	59,969	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	207	205	733	83,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,243	1,239	6,775	771,988	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	199	208	908	103,461	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	129	125	936	106,686	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	197	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	235	235	1,074	122,429	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	329	338	32,120	3,659,812	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	206	204	1,456	165,904	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	118	115	1,241	141,462	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	128	131	1,313	149,660	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	242	225	788	89,801	各種金融
CERNER CORP	254	257	1,664	189,619	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	321	337	7,803	889,124	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	124	124	715	81,468	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	83	77	694	79,185	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	250	257	1,517	172,884	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC	101	147	1,347	153,573	商業・専門サービス
EBAY INC	893	893	3,047	347,216	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	445	452	5,725	652,394	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	184	198	1,618	184,436	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	41	41	7,511	855,890	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	980	1,026	16,766	1,910,321	各種金融
BB&T CORP	670	681	2,932	334,157	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	903	888	4,167	474,837	各種金融
BORGWARNER INC	185	174	730	83,182	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	194	177	469	53,504	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	97	97	1,214	138,367	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	661	647	6,397	728,978	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	161	137	1,224	139,518	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	54	47	489	55,742	保険
AETNA INC	288	294	4,254	484,801	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	204	205	1,119	127,517	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	408	415	2,805	319,649	公益事業
AON PLC	226	221	2,748	313,209	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	493	483	2,033	231,753	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	78	76	485	55,277	保険
HESS CORP	232	237	1,178	134,321	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	288	283	867	98,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	221	217	822	93,711	各種金融
RED HAT INC	151	151	1,345	153,288	ソフトウェア・サービス

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	
F5 NETWORKS INC	58	55	726	82,732	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	186	188	1,164	132,661	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	147	148	738	84,153	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	242	230	924	105,374	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	138	142	1,659	189,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	342	369	581	66,212	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	184	182	4,639	528,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	121	123	2,244	255,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	412	417	5,692	648,656	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	203	208	2,403	273,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	768	2,457	280,018	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	137	127	468	53,349	小売
CELGENE CORP	650	650	7,774	885,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	503	509	3,275	373,184	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	559	517	3,141	357,917	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	154	154	820	93,466	運輸
FASTENAL CO	227	239	1,078	122,933	資本財
FISERV INC	189	183	2,199	250,630	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	462	442	719	81,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,745	1,401	676	77,104	メディア
SANDISK CORP	166	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	4,612	4,475	68,893	7,849,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128	128	893	101,818	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	659	915	1,171	133,477	銀行
COSTAR GROUP INC	—	27	682	77,795	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	186	188	2,241	255,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	52	—	—	—	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	118	121	846	96,394	運輸
CENTURYLINK INC	454	454	1,111	126,656	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	114	118	442	50,441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	345	383	1,510	172,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	173	174	895	102,013	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	709	717	4,679	533,223	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY	247	244	1,037	118,172	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	117	114	802	91,462	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	60	60	886	101,007	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	311	313	1,059	120,753	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	143	149	2,666	303,801	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	170	589	67,179	エネルギー
COOPER COS INC/THE	40	40	834	95,044	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	132	147	834	95,086	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	255	261	1,896	216,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	81	83	549	62,652	保険
AGCO CORP	55	51	328	37,408	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	122	123	325	37,071	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	117	336	1,610	183,493	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	102	103	1,450	165,316	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	193	200	546	62,246	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	495	508	1,503	171,337	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	144	133	1,698	193,524	各種金融
TESORO CORP	99	96	791	90,216	エネルギー
FNF GROUP	207	209	846	96,474	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	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	98	500	2,954	336,669	各種金融
NASDAQ INC	94	96	645	73,504	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	149	145	304	34,730	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	288	288	994	113,303	メディア
AUTOLIV INC	72	72	739	84,248	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	249	251	877	99,931	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	24	1,179	134,367	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	56	—	—	—	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	95	173	863	98,343	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	367	341	809	92,232	小売
ARROW ELECTRONICS INC	77	76	587	66,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	139	134	2,138	243,689	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	101	101	552	62,917	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	271	266	675	76,991	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	46	50	1,173	133,652	素材
RANGE RESOURCES CORP	140	161	409	46,688	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	315	432	323	36,831	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	78	78	924	105,294	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	48	48	387	44,180	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	96	191	755	86,081	公益事業
OCEANEERING INTL INC	80	—	—	—	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	96	89	861	98,132	消費者サービス
HANESBRANDS INC	324	322	719	81,935	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	819	807	9,413	1,072,537	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	418	400	779	88,779	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	76	133	597	68,132	資本財
AVNET INC	109	104	391	44,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	263	284	673	76,744	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	80	150	323	36,865	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	556	—	—	—	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	44	44	1,081	123,201	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	—	98	693	79,056	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	108	109	1,559	177,641	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	253	291	500	56,970	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	319	299	2,291	261,145	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	353	332	2,005	228,452	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	93	92	506	57,709	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	45	44	522	59,571	資本財
MERCADOLIBRE INC	—	33	926	105,607	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	65	57	538	61,356	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	234	242	1,114	126,971	保険
TIME WARNER CABLE	234	—	—	—	メディア
SEATTLE GENETICS INC	—	85	527	60,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	50	49	1,492	170,004	小売
LKQ CORP	252	253	785	89,467	小売
HORMEL FOODS CORP	240	238	820	93,465	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	66	519	59,212	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	123	121	946	107,817	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	85	—	—	—	小売
HARRIS CORP	103	105	1,149	130,976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	122	125	2,889	329,248	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	135	130	350	39,910	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NRG ENERGY INC	262	—	—	—	公益事業
INVESCO LTD	350	339	1,090	124,243	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	133	144	1,288	146,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	115	115	593	67,616	各種金融
TERADATA CORP	113	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	137	140	816	93,079	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	107	122	1,627	185,392	エネルギー
MSCI INC	81	75	737	83,985	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	82	344	39,293	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	153	158	1,483	169,051	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,281	1,302	14,479	1,649,743	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,610	1,566	14,429	1,644,138	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	156	154	1,401	159,676	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	34	37	404	46,080	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	380	383	950	108,324	エネルギー
FLOWSERVE CORP	108	111	546	62,310	資本財
HELMERICH & PAYNE	89	92	538	61,409	エネルギー
T-MOBILE US INC	237	243	1,599	182,255	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	62	69	475	54,199	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	228	185	476	54,237	メディア
RESMED INC	115	115	787	89,698	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	69	76	860	98,006	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	197	193	1,155	131,680	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	101	101	968	110,377	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	108	214	1,085	123,711	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	76	77	663	75,600	運輸
PERRIGO CO PLC	121	118	894	101,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	129	—	—	—	資本財
FMC CORP	110	110	812	92,631	素材
WABTEC CORP	79	73	592	67,505	資本財
EVERSOURCE ENERGY	265	270	1,607	183,105	公益事業
NETSUITE INC	32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	—	59	701	79,930	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	326	314	7,274	828,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	53	—	—	—	素材
CROWN HOLDINGS INC	116	114	649	73,987	素材
CALPINE CORP	285	272	339	38,682	公益事業
EATON VANCE CORP	95	96	431	49,190	各種金融
DELTA AIR LINES INC	165	156	778	88,752	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	163	155	1,379	157,230	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	151	150	1,142	130,129	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	133	131	1,032	117,653	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	243	237	1,708	194,671	小売
FORTINET INC	121	125	491	55,957	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	79	69	538	61,357	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	22	1,231	140,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	141	167	780	88,960	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	970	1,035	124	14,158	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	1,169	1,155	3,940	449,010	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	112	247	2,639	300,738	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	315	291	2,386	271,942	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	38	743	84,680	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	
HCA HEALTHCARE INC	270	252	2,155	245,601	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	321	—	—	—	運輸
HOLLYFRONTIER CORP	144	134	374	42,640	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	441	444	2,333	265,884	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	87	91	735	83,767	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	132	126	798	90,984	資本財
DEXCOM INC	—	73	503	57,341	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	—	49	658	75,030	資本財
XYLEM INC	148	147	748	85,266	資本財
TRIPADVISOR INC	97	96	441	50,347	小売
MEDIVATION INC	140	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	50	49	765	87,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	120	130	1,186	135,236	銀行
ALLEGHANY CORP	12	13	757	86,296	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	63	65	2,872	327,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	441	394	3,137	357,536	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,878	1,964	29,475	3,358,439	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	235	237	1,072	122,196	公益事業
ALBEMARLE CORP	92	93	1,036	118,063	素材
PVH CORP	68	68	693	79,039	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	95	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC	1,570	1,595	3,208	365,584	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	286	298	1,214	138,391	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	231	228	1,983	226,010	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	69	—	—	—	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	141	145	580	66,184	資本財
SPLUNK INC	106	110	745	84,989	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	169	165	558	63,690	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	51	49	454	51,798	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	1,352	1,363	8,904	1,014,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	81	108	3,494	398,180	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	186	166	782	89,193	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	122	—	—	—	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	106	105	790	90,120	各種金融
ZOETIS INC	392	396	2,364	269,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	96	92	425	48,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	314	305	387	44,102	メディア
SPRINT CORP	644	681	536	61,113	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	197	—	—	—	公益事業
SNAP-ON INC	48	47	814	92,799	資本財
AGL RESOURCES INC	102	—	—	—	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	152	139	518	59,075	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	481	474	872	99,433	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	130	133	834	95,113	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	93	101	903	102,927	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	125	140	1,355	154,424	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	75	74	912	103,970	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	76	—	—	—	資本財
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	65	78	1,069	121,913	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	158	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	257	260	24,256	2,763,738	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	137	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NAVIENT CORP	300	257	368	42,020	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	178	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	77	69	798	90,967	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	133	112	525	59,836	運輸
VOYA FINANCIAL INC	177	166	607	69,224	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	36	—	—	—	素材
ANTERO RESOURCES CORP	67	136	286	32,627	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	77	125	1,046	119,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	360	347	654	74,581	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	408	164	1,022	116,551	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	112	105	657	74,948	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	73	740	84,324	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	—	88	751	85,638	メディア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	133	130	689	78,611	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	67	76	877	100,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD	62	51	316	36,115	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	689	694	1,869	213,054	各種金融
QORVO INC	116	109	731	83,349	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	99	—	—	—	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	151	833	94,976	保険
ACUITY BRANDS INC	36	37	709	80,876	資本財
JONES LANG LASALLE INC	37	36	424	48,387	不動産
ARAMARK	188	190	705	80,410	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	435	430	1,591	181,324	銀行
LEAR CORP	62	57	836	95,361	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	63	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHITEWAVE FOODS CO	146	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	119	186	584	66,602	素材
RITE AID CORP	857	910	365	41,607	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP	—	155	788	89,875	エネルギー
BAXALTA INC	588	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLUMBIA PIPELINE GROUP	322	—	—	—	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	—	95	196	22,381	メディア
WESTROCK CO	223	208	1,131	128,944	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	502	510	4,560	519,624	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	909	911	4,532	516,403	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	42	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	83	93	402	45,842	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,492	1,401	2,643	301,214	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	65	147	906	103,275	ソフトウェア・サービス
AMERCO	6	6	222	25,321	運輸
CDW CORP/DE	119	119	713	81,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC	77	79	440	50,210	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP	172	181	445	50,755	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	277	455	51,856	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	59	60	419	47,827	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	143	162	315	35,901	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	167	169	621	70,839	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	74	79	292	33,356	メディア
DOMINO'S PIZZA INC	—	41	801	91,272	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	181	5,904	672,739	メディア
IDEXX LABORATORIES INC	—	76	1,240	141,296	ヘルスケア機器・サービス

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
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SMITH (A. O.) CORP	—	121	654	74,600	資本財	
UGI CORP	—	146	717	81,745	公益事業	
WESTAR ENERGY INC	—	119	618	70,424	公益事業	
FORTIVE CORP	—	263	1,646	187,648	資本財	
IHS MARKIT LTD	—	299	1,301	148,244	商業・専門サービス	
XL GROUP LTD	—	222	929	105,937	保険	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	187	1,236	140,837	ソフトウェア・サービス	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	—	53	648	73,917	素材	
COTY INC-CL A	—	397	779	88,808	家庭用品・パーソナル用品	
ARCONIC INC	—	364	992	113,065	資本財	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	186	594	67,774	エネルギー	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	53	659	75,153	保険	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	23	299	34,081	家庭用品・パーソナル用品	
TELEFLEX INC	—	36	697	79,526	ヘルスケア機器・サービス	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	135	439	50,127	電気通信サービス	
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	100	577	65,769	ヘルスケア機器・サービス	
TECHNIPPMC PLC	—	368	1,162	132,399	エネルギー	
DXC TECHNOLOGY CO	—	238	1,896	216,101	ソフトウェア・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	480	970	744	84,880	不動産	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	190	801	91,270	資本財	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	200	210	1,375	156,676	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	260,387	261,696	1,765,170	201,123,523	
	銘柄 数 < 比 率 >	596	596	—	< 60.4% >	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	1,228	1,246	11,556	960,704	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	247	250	988	82,153	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	286	273	1,645	136,825	各種金融	
TRANSCANADA CORP	588	730	4,627	384,681	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	301	308	1,918	159,513	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	506	518	2,410	200,407	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	470	466	1,155	96,071	素材	
BARRICK GOLD CORP	965	985	2,252	187,266	素材	
BCE INC	120	132	809	67,298	電気通信サービス	
AGRIUM INC	109	108	1,347	112,036	素材	
BOMBARDIER INC-B	1,596	1,707	377	31,360	資本財	
BANK OF MONTREAL	530	542	5,120	425,693	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	733	752	3,921	326,009	各種金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	995	1,013	7,677	638,232	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	268	283	533	44,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	218	215	462	38,408	資本財	
CAMECO CORP	330	348	468	38,967	エネルギー	
CI FINANCIAL CORP	195	207	553	45,996	各種金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	328	333	3,572	297,003	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	907	929	3,940	327,600	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	659	645	6,533	543,158	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	59	56	875	72,803	小売	
ENBRIDGE INC	760	1,371	7,508	624,220	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	18	19	1,151	95,715	保険	
CGI GROUP INC - CLASS A	183	183	1,217	101,210	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	292	281	455	37,830	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	80	86	340	28,310	各種金融	
LOBLAW COMPANIES LTD	188	184	1,418	117,916	食品・生活必需品小売り	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,631	1,661	3,973	330,284	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	335	322	1,969	163,738	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	284	284	1,503	125,009	銀行
ONEX CORPORATION	71	68	682	56,720	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	691	700	1,567	130,289	素材
POWER CORP OF CANADA	310	314	937	77,969	保険
POWER FINANCIAL CORP	208	204	674	56,030	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	337	357	1,024	85,203	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,310	1,402	6,059	503,721	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	43	41	502	41,813	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	120	117	2,503	208,092	運輸
ENCANA CORP	699	803	1,249	103,868	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	180	185	1,205	100,194	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	145	133	355	29,564	資本財
GOLDCORP INC	687	729	1,409	117,203	素材
KINROSS GOLD CORP	1,019	995	559	46,485	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	124	126	672	55,901	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	247	246	845	70,266	保険
METHANEX CORP	73	71	409	34,055	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	849	869	314	26,150	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	70	71	155	12,925	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	192	179	699	58,137	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	211	208	924	76,824	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	424	404	518	43,122	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	116	116	530	44,126	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	571	586	717	59,674	素材
YAMANA GOLD INC	785	824	304	25,344	素材
FORTIS INC	236	344	1,531	127,284	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	347	354	2,221	184,690	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	580	624	312	25,936	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,533	1,559	9,887	821,921	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	145	148	1,410	117,286	素材
SILVER WHEATON CORP	361	375	1,026	85,322	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	133	144	302	25,138	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	87	82	444	36,973	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	107	104	414	34,435	公益事業
METRO INC	199	199	917	76,262	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	101	215	963	80,070	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	109	109	1,010	84,042	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	419	459	609	50,633	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	692	874	1,140	94,815	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	288	305	549	45,714	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	160	197	557	46,313	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	309	336	1,465	121,865	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	93	94	460	38,274	エネルギー
DOLLARAMA INC	99	95	1,162	96,608	小売
KEYERA CORP	143	160	640	53,243	エネルギー
ALTAGAS LTD	126	148	455	37,869	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	124	142	371	30,856	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	66	63	313	26,065	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	97	115	229	19,052	不動産
INTER PIPELINE LTD	280	296	807	67,126	エネルギー

銘柄	株数	当期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	151	162	479	39,862	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	133	211	554	46,131	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	16	1,094	91,002	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	168	185	1,502	124,914	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	57	56	320	26,614	素材
VERESEN INC	258	255	471	39,216	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	23	24	727	60,450	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	323	306	365	30,347	各種金融
LINAMAR CORP	39	43	274	22,816	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD	—	168	387	32,233	公益事業
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	92	—	—	—	商業・専門サービス
EMERA INC	—	50	235	19,543	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	32,985 90	35,203 91	142,733 —	11,865,402 <3.6%>
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	882	881	838	103,746	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,141	1,738	3,014	373,133	各種金融
METRO AG	147	152	450	55,718	食品・生活必需品小売り
SIEMENS AG-REG	655	641	8,389	1,038,604	資本財
RWE AG	407	403	628	77,852	公益事業
BASF SE	759	770	6,940	859,250	素材
VOLKSWAGEN AG	29	26	384	47,617	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	796	808	5,558	688,196	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	146	149	1,876	232,341	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	1,661	1,861	1,341	166,115	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	274	277	2,505	310,128	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	684	694	7,990	989,177	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG	153	155	2,608	322,965	素材
ALLIANZ SE-REG	377	382	6,635	821,515	保険
MAN SE	29	29	282	34,973	資本財
CONTINENTAL AG	90	92	1,932	239,275	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	933	953	1,818	225,141	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	126	130	698	86,467	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	204	210	352	43,681	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	55	53	371	45,964	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	801	814	2,587	320,320	運輸
SAP SE	812	824	7,745	958,899	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	181	193	749	92,733	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG	159	162	1,516	187,757	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	180	180	1,550	191,945	ヘルスケア機器・サービス
ADIDAS AG	34	33	239	29,628	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	173	158	2,833	350,818	耐久消費財・アパレル
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,669	2,748	4,594	568,809	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG	137	134	2,360	292,237	保険
BEIERSDORF AG	305	302	673	83,395	素材
HEIDELBERGCEMENT AG	82	82	775	96,066	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	116	123	1,066	132,008	素材
VOLKSWAGEN AG-PREF	106	109	1,221	151,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LANXESS AG	153	156	2,245	278,002	自動車・自動車部品
FRESENIUS SE & CO KGAA	75	74	490	60,782	素材
HOCHTIEF AG	315	344	2,699	334,177	ヘルスケア機器・サービス
	—	16	271	33,550	資本財

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	279	294	995	123,186	不動産	
GEA GROUP AG	150	156	582	72,105	資本財	
SYMRISE AG	102	100	651	80,597	素材	
K+S AG-REG	158	166	371	45,935	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	85	86	935	115,827	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	102	105	449	55,705	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	44	46	367	45,491	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	49	50	550	68,209	保険	
BRENTAG AG	127	127	682	84,434	資本財	
AXEL SPRINGER SE	37	37	200	24,858	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	59	290	35,978	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	625	647	264	32,768	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	73	75	508	62,999	資本財	
VONOVIA SE	386	391	1,391	172,258	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	114	130	404	50,103	素材	
ZALANDO SE	69	75	294	36,457	小売	
COVESTRO AG	—	74	491	60,885	素材	
SCHAEFFLER AG	—	146	217	26,931	自動車・自動車部品	
INNOGY SE	—	122	412	51,106	公益事業	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	18,327	19,768	98,304	12,170,037	
		52	56	—	<3.7%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	961	984	1,461	180,900	保険	
INTESA SANPAOLO	10,499	10,651	3,016	373,444	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	9,508	9,443	831	102,883	電気通信サービス	
ENI SPA	2,105	2,143	3,194	395,427	エネルギー	
UNICREDIT SPA	3,948	1,589	2,650	328,134	銀行	
ENEL SPA	6,331	6,437	2,937	363,601	公益事業	
SAIPEM SPA	4,956	5,277	211	26,127	エネルギー	
ATLANTIA SPA	342	342	827	102,428	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	762	800	213	26,414	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	139	138	750	92,943	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	466	484	444	55,071	銀行	
SNAM SPA	1,760	2,037	864	107,075	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RSP	4,971	5,183	373	46,266	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	308	—	—	—	銀行	
LEONARDO SPA	350	343	544	67,439	資本財	
UBI BANCA SPA	734	—	—	—	銀行	
TERNA SPA	1,281	1,253	616	76,363	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	908	975	213	26,448	保険	
PRYSMIAN SPA	160	158	408	50,564	資本財	
EXOR SPA	93	—	—	—	各種金融	
POSTE ITALIANE SPA	—	442	282	34,957	保険	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	50,592	48,688	19,842	2,456,493	
		20	18	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	154	153	1,870	231,536	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	231	234	5,460	675,966	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	366	400	774	95,864	自動車・自動車部品	
AXA SA	1,627	1,624	3,943	488,250	保険	
DANONE	487	495	3,309	409,671	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	458	476	1,048	129,852	食品・生活必需品小売り	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VIVENDI	960	865	1,591	196,976	メディア
INGENICO GROUP	45	44	378	46,835	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	600	643	3,173	392,896	銀行
AIR LIQUIDE SA	284	326	3,698	457,887	素材
TOTAL SA	1,816	1,909	9,142	1,131,822	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	394	420	2,117	262,111	資本財
ZODIAC AEROSPACE	168	172	380	47,137	資本財
VINCI SA	396	426	3,314	410,308	資本財
SANOFI	971	973	8,900	1,101,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	380	399	753	93,317	公益事業
L'OREAL	207	210	3,987	493,695	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	175	145	611	75,748	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	461	471	3,329	412,202	資本財
BNP PARIBAS	876	942	6,256	774,528	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	169	173	2,074	256,883	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	135	137	1,310	162,218	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	48	43	232	28,804	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	65	201	1,312	162,505	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	21	21	971	120,296	耐久消費財・アパレル
SODEXO	77	77	924	114,480	消費者サービス
KERING	62	63	1,876	232,265	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	106	108	902	111,671	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	87	—	—	—	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	45	45	1,153	142,853	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	72	74	936	115,894	ソフトウェア・サービス
ORANGE	1,644	1,675	2,485	307,743	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	142	138	277	34,305	保険
IMERYS SA	29	31	238	29,516	素材
SAFRAN SA	258	262	1,991	246,565	資本財
RENAULT SA	158	161	1,422	176,099	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	156	159	1,050	130,018	メディア
LAGARDERE SCA	95	102	280	34,780	メディア
JCDECAUX SA	61	64	187	23,245	メディア
SOCIETE BIC SA	23	24	264	32,794	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	167	170	649	80,355	資本財
THALES SA	86	89	873	108,187	資本財
PERNOD RICARD SA	175	178	2,149	266,075	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	874	945	1,340	165,902	銀行
ENGIE	1,215	1,332	1,841	227,919	公益事業
ALSTOM	128	123	368	45,653	資本財
ARKEMA	55	55	543	67,304	素材
LEGRAND SA	220	224	1,384	171,413	資本財
SCOR SE	126	138	489	60,640	保険
ADP	24	26	334	41,367	運輸
EDF	201	316	274	34,014	公益事業
NATIXIS	779	808	522	64,657	銀行
WENDEL	23	23	309	38,311	各種金融
BUREAU VERITAS SA	221	228	487	60,402	商業・専門サービス
EURAZEO	32	34	221	27,408	各種金融
SUEZ	255	282	468	58,018	公益事業
EIFFAGE	—	47	370	45,856	資本財
ILIAD SA	21	22	517	64,010	電気通信サービス

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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	141	152	315	39,111		メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	393	403	414	51,372		運輸
EDENRED	172	180	429	53,157		商業・専門サービス
REMY COINTREAU	19	19	187	23,186		食品・飲料・タバコ
REXEL SA	255	258	397	49,237		資本財
BOLLORE	711	764	302	37,387		運輸
SPR GROUP SA	91	78	244	30,285		電気通信サービス
DASSAULT AVIATION SA	—	2	261	32,369		資本財
SEB SA	—	18	272	33,782		耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額	20,923	21,831	99,909	12,368,852	
	銘柄 数 < 比 率 >	64	66	—	< 3.7% >	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.	183	188	554	68,615		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	786	852	835	103,483		資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	743	745	742	91,897		自動車・自動車部品
FERRARI NV	105	106	805	99,733		自動車・自動車部品
EXOR NV	—	88	470	58,243		各種金融
AIRBUS SE	489	486	3,603	446,122		資本財
STMICROELECTRONICS NV	512	530	799	98,988		半導体・半導体製造装置
GEMALTO	66	69	363	45,039		ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	249	251	974	120,615		商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV	2,654	2,842	809	100,238		電気通信サービス
AKZO NOBEL	204	212	1,595	197,579		素材
HEINEKEN NV	190	193	1,650	204,340		食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	787	797	2,629	325,474		資本財
RELX NV	822	839	1,527	189,125		商業・専門サービス
AEGON NV	1,506	1,450	665	82,405		保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	688	1,074	2,124	263,029		食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	105	101	571	70,703		商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	83	85	690	85,458		食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	149	150	993	122,989		素材
ING GROEP NV	3,201	3,254	4,978	616,318		銀行
ASML HOLDING NV	286	313	3,843	475,777		半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA	1,346	1,367	6,757	836,576		家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	58	62	263	32,565		エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER	72	78	254	31,455		資本財
TNT EXPRESS NV	417	—	—	—		運輸
OCI NV	73	—	—	—		素材
NN GROUP NV	261	263	841	104,132		保険
ALTICE NV - B	87	94	211	26,165		メディア
ALTICE NV - A	310	306	689	85,403		メディア
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	233	571	70,772		銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	16,445	17,040	40,817	5,053,252	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	28	—	< 1.5% >	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	1,432	2,911	229	28,404		銀行
ENDESA SA	265	264	551	68,314		公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	158	195	676	83,734		資本財
IBERDROLA SA	4,556	4,655	3,118	386,127		公益事業
TELEFONICA SA	3,725	3,808	3,820	472,965		電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	11,932	12,241	7,418	918,405		銀行
BANKINTER SA	553	547	462	57,206		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…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
REPSOL SA	908	952	1,397	173,005	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,369	5,614	4,146	513,344	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	293	288	590	73,118	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	898	914	3,277	405,747	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	429	542	876	108,537	運輸	
MAPPFRE SA	892	927	304	37,739	保険	
FERROVIAL SA	390	414	808	100,093	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	—	414	13	1,635	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	153	156	133	16,553	資本財	
ENAGAS SA	182	185	465	57,622	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	90	371	691	85,548	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	4,311	4,410	808	100,139	銀行	
CAIXABANK S. A	2,194	3,009	1,278	158,311	銀行	
GRIFOLS SA	245	254	641	79,366	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	361	369	1,919	237,623	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	681	705	500	62,018	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	486	543	292	36,245	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	3,782	3,727	410	50,806	銀行	
AENA SA	55	56	930	115,196	運輸	
小 計	株 数	金 額	44,354	48,483	35,765	4,427,813
	銘柄 数 < 比 率 >		25	26	—	< 1.3% >
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	166	158	591	73,232	保険	
UCB SA	104	104	798	98,870	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	665	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	66	67	591	73,241	各種金融	
DELHAIZE GROUP	85	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	78	77	457	56,576	素材	
COLRUYT SA	58	57	273	33,884	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	207	211	1,404	173,859	銀行	
SOLVAY SA	61	61	746	92,378	素材	
PROXIMUS	126	131	396	49,070	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	46	42	242	30,025	メディア	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	—	640	6,986	864,956	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数	金 額	1,667	1,554	12,488	1,546,097
	銘柄 数 < 比 率 >		11	10	—	< 0.5% >
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	232	250	819	101,458	銀行	
OMV AG	123	127	540	66,938	エネルギー	
VOESTALPINE AG	93	97	379	46,960	素材	
ANDRITZ AG	64	62	338	41,908	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	103	105	226	28,023	銀行	
小 計	株 数	金 額	616	645	2,304	285,290
	銘柄 数 < 比 率 >		5	5	—	< 0.1% >
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	31	32	220	27,357	メディア	
TENARIS SA	386	402	579	71,761	エネルギー	
SES	270	310	635	78,617	メディア	
EUROFINS SCIENTIFIC	—	9	441	54,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	1,408	1,532	1,107	137,087	素材	
小 計	株 数	金 額	2,096	2,287	2,984	369,516
	銘柄 数 < 比 率 >		4	5	—	< 0.1% >

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	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NOKIA OYJ	4,772	4,900	2,744	339,744		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	452	472	538	66,678		素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	94	92	350	43,413		自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	439	445	1,098	136,028		素材
FORTUM OYJ	371	385	533	65,998		公益事業
KONE OYJ-B	277	281	1,202	148,893		資本財
METSO OYJ	93	90	284	35,169		資本財
SAMPO OYJ-A SHS	368	373	1,697	210,167		保険
WARTSILA OYJ ABP	121	121	659	81,671		資本財
ELISA OYJ	118	122	410	50,758		電気通信サービス
NESTE OYJ	106	110	414	51,349		エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	84	88	506	62,686		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	7,301	7,483	10,440	1,292,561	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	12	-	< 0.4% >	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	135	135	1,098	135,976		食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC	70	70	686	85,022		消費者サービス
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	472	472	-	-		銀行
BANK OF IRELAND	23,370	24,069	594	73,600		銀行
CRH PLC	691	711	2,438	301,941		素材
小 計	株 数 ・ 金 額	24,739	25,459	4,818	596,540	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	-	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,934	2,063	674	83,451		公益事業
JERONIMO MARTINS	207	200	337	41,723		食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	35,849	-	-	-		銀行
GALP ENERGIA SGPS SA	383	432	617	76,417		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	38,374	2,696	1,628	201,592	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	3	-	< 0.1% >	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	-	183	672	83,224		食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	-	183	672	83,224	
	銘柄 数 < 比 率 >	-	1	-	< 0.0% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	225,438	196,121	329,977	40,851,273	
	銘柄 数 < 比 率 >	230	235	-	< 12.3% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	13,882	14,226	2,938	431,276		銀行
BP PLC	15,163	15,886	7,243	1,063,133		エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	47,240	53,905	3,755	551,130		銀行
ASTRAZENECA PLC	1,045	1,062	5,043	740,228		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	326	324	536	78,770		資本財
NEXT PLC	120	118	510	74,897		小売
DIAGEO PLC	2,080	2,111	4,851	712,013		食品・飲料・タバコ
SKY PLC	856	857	854	125,464		メディア
BAE SYSTEMS PLC	2,614	2,673	1,714	251,565		資本財
UNILEVER PLC	1,060	1,077	4,402	646,166		家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	6,742	6,877	1,240	182,049		食品・生活必需品小売り
RELX PLC	920	916	1,469	215,745		商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,348	1,377	519	76,226		小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	526	528	3,859	566,462		家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	2,127	2,164	3,811	559,400		保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,916	5,006	1,275	187,157		保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	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	
SAGE GROUP PLC/THE	893	895	615	90,399	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	16,192	16,605	11,258	1,652,437	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,542	1,564	8,354	1,226,138	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	581	578	591	86,819	公益事業
SCHRODERS PLC	102	108	353	51,817	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,873	2,948	768	112,846	銀行
BHP BILLITON PLC	1,747	1,772	2,080	305,363	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	793	805	2,971	436,143	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	1,070	1,076	1,835	269,326	メディア
CENTRICA PLC	4,221	4,608	885	130,007	公益事業
BT GROUP PLC	7,008	7,104	2,116	310,577	電気通信サービス
SSE PLC	839	861	1,248	183,287	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	2,708	2,758	2,076	304,711	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,520	1,546	1,348	197,864	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	112,647	114,200	11	1,676	資本財
COMPASS GROUP PLC	1,358	1,380	2,200	322,962	消費者サービス
KINGFISHER PLC	1,891	1,896	654	96,033	小売
PEARSON PLC	678	702	497	73,066	メディア
SEVERN TRENT PLC	203	207	504	73,991	公益事業
RIO TINTO PLC	1,025	1,037	3,100	455,088	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,027	4,096	6,666	978,435	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	803	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	121	125	410	60,293	各種金融
3I GROUP PLC	793	795	661	97,118	各種金融
GKN PLC	1,415	1,460	513	75,359	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	21,964	22,328	4,605	675,918	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,835	1,902	460	67,613	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	1,109	1,385	367	53,904	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	3,343	3,411	1,833	269,103	保険
CAPITA PLC	552	536	300	44,092	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	806	843	275	40,370	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	159	165	517	75,895	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	841	833	512	75,199	保険
WHITBREAD PLC	150	155	636	93,420	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	3,112	3,171	3,274	480,639	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	1,162	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	210	211	1,054	154,706	資本財
BUNZL PLC	277	276	675	99,092	資本財
COBHAM PLC	976	2,080	278	40,922	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	1,160	1,177	1,238	181,738	素材
INTERTEK GROUP PLC	134	133	555	81,539	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	725	740	217	31,989	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	367	362	598	87,791	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	171	159	678	99,531	消費者サービス
CARNIVAL PLC	156	157	752	110,471	消費者サービス
PERSIMMON PLC	252	252	606	89,029	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	641	620	298	43,821	資本財
ICAP PLC	455	—	—	—	各種金融
ITV PLC	3,161	3,089	583	85,703	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	258	261	898	131,823	各種金融
G4S PLC	1,293	1,335	421	61,900	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	107	107	360	52,860	耐久消費財・アパレル

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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	826	854	515	75,587	耐久消費財・アパレル	
IMI PLC	225	217	280	41,181	資本財	
REXAM PLC	590	—	—	—	素材	
SMITH & NEPHEW PLC	740	733	960	141,009	ヘルスケア機器・サービス	
TATE & LYLE PLC	394	373	285	41,943	食品・飲料・タバコ	
TAYLOR WIMPEY PLC	2,685	2,778	551	80,979	耐久消費財・アパレル	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,260	3,664	7,815	1,147,028	エネルギー	
PETROFAC LTD	209	227	185	27,192	エネルギー	
TRAVIS PERKINS PLC	205	214	347	51,006	資本財	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,280	3,146	6,906	1,013,680	エネルギー	
OLD MUTUAL PLC	4,078	4,088	799	117,380	保険	
INVESTEC PLC	470	558	327	48,100	各種金融	
STANDARD LIFE PLC	1,628	1,799	692	101,695	保険	
EXPERIAN PLC	799	801	1,338	196,520	商業・専門サービス	
MONDI PLC	302	301	603	88,607	素材	
WEIR GROUP PLC/THE	181	186	348	51,112	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	294	295	848	124,574	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	317	342	266	39,062	素材	
SHIRE PLC	490	757	3,549	520,922	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INMARSAT PLC	374	394	297	43,691	電気通信サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	174	183	374	54,971	保険	
FRESNILLO PLC	178	175	263	38,676	素材	
RANDGOLD RESOURCES LTD	76	78	563	82,714	素材	
AGGREKO PLC	207	—	—	—	商業・専門サービス	
BABCOCK INTL GROUP PLC	208	218	195	28,648	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	434	451	526	77,319	保険	
GLENCORE PLC	10,122	10,267	2,978	437,081	素材	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	759	827	241	35,464	各種金融	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	215	207	298	43,822	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	113	111	435	63,879	素材	
COCA-COLA HBC AG-DI	165	154	338	49,670	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	141	141	183	26,958	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,127	1,112	393	57,799	保険	
ROYAL MAIL PLC	743	770	325	47,816	運輸	
ASHTREAD GROUP PLC	416	414	671	98,553	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	236	—	—	—	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	587	566	283	41,580	消費者サービス	
TUI AG-DI	410	422	498	73,111	消費者サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	125	224	32,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	304	322	270	39,674	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	792	841	343	50,381	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	1,170	1,488	467	68,619	ソフトウェア・サービス	
DCC PLC	—	73	540	79,338	資本財	
小計	株数・金額	353,365	364,644	155,092	22,762,882	
	銘柄数<比率>	109	105	—	<6.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	2,637	2,611	21,084	2,383,764	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	431	439	3,771	426,418	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,487	1,723	2,575	291,141	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	376	383	2,157	243,967	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	581	589	15,774	1,783,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	7	7	1,523	172,228	素材	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円			
SONOVA HOLDING AG-REG	44	43	657	74,345		ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	124	126	3,540	400,331		保険	
SYNGENTA AG-REG	76	77	3,653	413,045		素材	
LONZA GROUP AG-REG	43	50	1,011	114,376		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	40	43	344	38,919		耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	36	34	708	80,053		資本財	
GEBERIT AG-REG	31	31	1,439	162,795		資本財	
SWISS RE AG	290	272	2,421	273,756		保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	25	25	1,048	118,569		耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	27	31	232	26,340		各種金融	
NOVARTIS AG-REG	1,882	1,874	14,799	1,673,230		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	137	137	1,062	120,128		商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	21	21	990	111,945		電気通信サービス	
ABB LTD-REG	1,819	1,584	3,916	442,764		資本財	
SGS SA-REG	4	4	1,066	120,549		商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	11	—	—	—		資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	16	17	353	39,974		資本財	
ACTELION LTD-REG	84	81	2,293	259,289		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	44	45	686	77,605		運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	40	41	618	69,871		保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	26	27	884	100,055		保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.09	0.08	558	63,119		食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	74	76	266	30,162		食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	185	191	1,011	114,305		各種金融	
SIKA AG-BR	1	1	1,146	129,634		素材	
SWISS PRIME SITE-REG	55	60	535	60,535		不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.81	0.9	522	59,068		食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	13	15	941	106,413		各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	277	31,404		食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	6	7	460	52,103		素材	
UBS GROUP AG-REG	3,026	3,075	5,172	584,826		各種金融	
DUFREY AG-REG	33	30	492	55,711		小売	
GALENICA AG-REG	3	3	378	42,776		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	13,757	13,793	100,379	11,348,960	
銘 柄 数 < 比 率 >	39	38	—	< 3.4% >			
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ				
ELECTROLUX AB-SER B	199	204	5,600	71,853		耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	2,516	2,581	14,854	190,577		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	321	323	9,602	123,195		資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,254	1,276	13,547	173,811		銀行	
INVESTOR AB-B SHS	375	380	15,628	200,518		各種金融	
NORDEA BANK AB	2,509	2,546	28,617	367,168		銀行	
GETINGE AB-B SHS	166	173	3,073	39,432		ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,239	1,283	16,221	208,117		銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	556	567	18,881	242,244		資本財	
SKF AB-B SHARES	329	325	6,035	77,434		資本財	
ASSA ABLOY AB-B	829	842	16,293	209,041		資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	784	795	16,970	217,730		小売	
SANDVIK AB	882	892	12,509	160,499		資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	749	760	16,394	210,340		銀行	
SECURITAS AB-B SHS	259	266	3,684	47,277		商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	500	511	15,136	194,198		家庭用品・パーソナル用品	

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	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
SKANSKA AB-B SHS	313	287	6,242	80,095	資本財	
SWEDISH MATCH AB	163	161	4,771	61,216	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	255	285	2,500	32,085	電気通信サービス	
TELIA CO AB	2,147	2,145	8,123	104,223	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	1,274	1,302	18,943	243,038	資本財	
ALFA LAVAL AB	242	249	4,476	57,434	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	179	148	2,541	32,613	エネルギー	
BOLIDEN AB	225	232	5,657	72,590	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	355	362	3,269	41,947	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	55	52	2,482	31,846	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	214	216	8,402	107,800	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINNEVIK AB - B	194	197	4,792	61,486	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	129	140	2,978	38,211	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	68	69	2,125	27,266	食品・生活必需品小売り	
LUNDBERGS AB-B SHS	—	31	2,101	26,966	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	19,293	19,614	292,460	3,752,262	
		30	31	—	< 1.1% >	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	809	822	12,077	160,021	銀行	
NORSK HYDRO ASA	1,105	1,132	5,330	70,633	素材	
ORKLA ASA	669	693	5,616	74,422	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	924	952	14,576	193,138	エネルギー	
TELENOR ASA	621	621	8,314	110,165	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	147	150	4,829	63,995	素材	
MARINE HARVEST	—	308	4,527	59,990	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	170	171	2,331	30,892	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A	64	66	1,495	19,814	メディア	
SCHIBSTED ASA-B SHS	76	75	1,530	20,275	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,588	4,995	60,630	803,348	
		9	10	—	< 0.2% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	1,621	1,605	44,143	734,546	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	193	188	5,582	92,891	素材	
DANSKE BANK A/S	585	581	14,835	246,869	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	21	104	1,745	29,051	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	185	186	11,523	191,742	資本財	
TDC A/S	675	653	2,424	40,351	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	88	88	6,256	104,106	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	92	101	5,523	91,910	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	160	157	6,104	101,579	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	5	5	6,565	109,241	運輸	
TRYG A/S	93	97	1,298	21,610	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	3	3	3,842	63,942	運輸	
PANDORA A/S	91	92	6,305	104,925	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	123	143	4,055	67,486	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	82	84	3,914	65,136	素材	
GENMAB A/S	44	48	6,513	108,386	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DONG ENERGY A/S	—	122	3,430	57,085	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,067	4,265	134,066	2,230,864	
		16	17	—	< 0.7% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	2,662	2,700	6,373	535,922	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
CSL LTD	385	383	5,209	438,093	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	2,146	2,161	382	32,178	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	618	641	2,094	176,092	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,412	2,467	7,229	607,951	銀行
RIO TINTO LTD	353	359	2,139	179,902	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,147	1,153	1,566	131,703	保険
LENLEASE GROUP	468	479	797	67,044	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,416	1,450	11,903	1,000,994	銀行
WESTPAC BANKING CORP	2,757	2,818	9,193	773,108	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,180	2,240	7,236	608,519	銀行
BRAMBLES LTD	1,325	1,331	1,402	117,967	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	494	469	226	19,006	運輸
BORAL LTD	622	964	659	55,452	素材
WOOLWORTHS LTD	1,057	1,089	2,952	248,314	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	3,585	3,534	1,555	130,774	電気通信サービス
AMP LTD	2,496	2,488	1,318	110,902	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	692	753	357	30,049	消費者サービス
AMCOR LIMITED	970	976	1,505	126,598	素材
COMPUTERSHARE LTD	403	386	588	49,507	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	464	451	924	77,774	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	256	261	2,444	205,546	各種金融
CIMIC GROUP LTD	84	88	357	30,025	資本財
ASX LTD	165	160	833	70,094	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	501	507	492	41,445	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	48	50	739	62,174	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	377	382	840	70,672	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	467	515	211	17,780	小売
NEWCREST MINING LTD	637	636	1,284	108,050	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,050	2,002	1,299	109,303	保険
ORIGIN ENERGY LTD	1,462	1,465	1,160	97,583	エネルギー
ORICA LTD	312	325	619	52,101	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	332	345	810	68,162	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	1,400	1,566	573	48,201	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	1,080	1,095	1,599	134,494	保険
TRANSURBAN GROUP	1,714	1,753	2,146	180,506	運輸
WESFARMERS LTD	936	954	4,210	354,063	食品・生活必需品小売り
CHALLENGER LTD	485	473	631	53,110	各種金融
SYDNEY AIRPORT	949	921	671	56,473	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	227	218	714	60,071	エネルギー
OIL SEARCH LTD	1,148	1,187	865	72,792	エネルギー
AGL ENERGY LTD	582	566	1,535	129,153	公益事業
TATTS GROUP LTD	1,244	1,202	526	44,280	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,276	1,332	648	54,559	素材
ASCIANO LTD	547	—	—	—	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	354	—	—	—	素材
AUSNET SERVICES	1,718	1,740	303	25,539	公益事業
CROWN RESORTS LTD	300	324	415	34,965	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,427	1,458	541	45,494	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	400	384	474	39,897	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	1,764	1,713	949	79,817	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	619	608	803	67,541	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	120	117	867	72,937	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)						
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	47	50	179	15,058	消費者サービス	
SEEK LTD	284	272	500	42,092	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	328	316	378	31,869	銀行	
REA GROUP LTD	48	48	310	26,136	メディア	
TPG TELECOM LTD	247	306	182	15,380	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	1,457	1,564	356	30,002	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,309	2,282	686	57,766	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	195	—	—	—	各種金融	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	56	374	31,456	消費者サービス	
SOUTH32 LTD	4,430	4,400	1,166	98,055	素材	
VOCUS GROUP LTD	390	465	116	9,814	電気通信サービス	
小計	株数・金額	63,400	63,425	99,445	8,362,334	
	銘柄数<比率>	63	61	—	<2.5%>	
(ニュージーランド)						
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,518	1,586	591	46,059	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	803	830	568	44,282	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	630	644	338	26,366	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	573	598	513	39,970	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	321	323	274	21,340	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,118	1,136	318	24,815	公益事業	
MERCURY NZ LTD	644	643	206	16,066	公益事業	
小計	株数・金額	5,610	5,763	2,812	218,901	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)						
WHARF HOLDINGS LTD	1,130	1,140	7,638	111,743	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	490	470	3,494	51,123	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,238	2,283	23,270	340,450	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,440	1,220	14,225	208,114	不動産	
MTR CORP	1,225	1,215	5,655	82,744	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	5,865	6,483	10,178	148,916	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,500	4,620	4,532	66,306	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,165	1,160	8,282	121,171	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	950	983	19,237	281,441	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,020	1,140	1,249	18,279	運輸	
HANG LUNG GROUP LTD	—	700	2,268	33,180	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,870	1,940	3,802	55,629	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	1,595	1,390	11,564	169,193	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	958	943	4,684	68,536	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	990	988	3,231	47,275	銀行	
HANG SENG BANK LTD	632	642	10,451	152,909	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	540	550	2,026	29,651	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,080	1,160	1,296	18,973	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	209	197	2,379	34,815	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	2,514	2,474	3,339	48,862	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	610	650	2,145	31,381	耐久消費財・アパレル	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	570	550	3,800	55,601	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,060	3,120	10,202	149,261	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	1,150	1,175	4,094	59,908	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	3,530	3,900	1,786	26,132	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	4,900	5,220	1,691	24,743	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	520	575	1,661	24,311	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	1,285	1,355	2,062	30,171	資本財	

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		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
SANDS CHINA LTD	2,008	2,008	6,947	101,644	消費者サービス	
WHEELOCK & CO LTD	750	670	4,090	59,841	不動産	
WYNN MACAU LTD	1,272	1,388	2,212	32,368	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	1,660	1,720	1,229	17,991	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	2,080	1,980	1,158	16,945	各種金融	
AIA GROUP LTD	9,976	10,142	56,643	828,688	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,004	1,014	2,605	38,125	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,940	1,990	8,059	117,910	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	852	852	1,421	20,791	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,280	3,240	3,246	47,496	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	4,875	6,570	4,461	65,264	食品・飲料・タバコ	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	2,238	2,268	12,976	189,851	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	76,974 39	82,087 40	275,307 —	4,027,751 <1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,561	2,640	2,787	225,564	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,344	1,419	479	38,819	メディア	
SEBPCORP INDUSTRIES LTD	801	903	285	23,087	資本財	
CAPITALAND LTD	2,156	2,094	764	61,840	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	360	319	346	28,004	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	97	78	365	29,598	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,461	1,496	3,131	253,339	銀行	
KEPPEL CORP LTD	1,208	1,186	785	63,525	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,071	1,109	2,658	215,080	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,357	1,266	481	38,924	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,613	6,864	2,546	206,058	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	479	496	535	43,336	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	671	702	518	41,917	各種金融	
SEBPCORP MARINE LTD	660	—	—	—	資本財	
UOL GROUP LTD	391	428	303	24,586	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,810	1,894	515	41,682	運輸	
NOBLE GROUP LTD	4,185	—	—	—	資本財	
STARHUB LTD	565	570	155	12,590	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,110	6,368	235	19,065	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,606	1,666	571	46,235	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	4,988	5,212	562	45,543	消費者サービス	
SATS LTD	—	610	323	26,158	運輸	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,640	2,302	669	54,200	不動産	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,726	1,665	207	16,772	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	44,863 23	41,289 22	19,230 —	1,555,931 <0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	406	447	675	21,347	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	755	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOALIM BM	877	913	2,084	65,841	銀行	
NICE LTD	48	48	1,305	41,238	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,161	1,238	2,087	65,929	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	—	20	861	27,209	資本財	
DELEK GROUP LTD	3	—	—	—	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,607	1,815	1,128	35,642	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	120	121	730	23,082	銀行	
AZRIELI GROUP LTD	31	35	736	23,254	不動産	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル) FRUTAROM	百株 —	百株 34	千イスラエルシェケル 724	千円 22,891	素材	
小計	株数・金額 5,013	4,674	10,336	326,437		
	銘柄数<比率> 9	9	—	<0.1%>		
合計	株数・金額 1,109,747	1,097,576	—	309,229,876		
	銘柄数<比率> 1,260	1,262	—	<92.9%>		

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	38	38	1,206	137,434	0.0	
MACERICH CO/THE	11	10	617	70,350	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	6	747	85,221	0.0	
PROLOGIS INC	43	44	2,434	277,439	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	7	7	607	69,267	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	12	451	51,464	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	12	13	1,514	172,592	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	5	1,379	157,214	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	9	10	778	88,665	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	5	758	86,464	0.0	
WELLTOWER INC	29	30	2,185	249,028	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	12	12	1,571	179,002	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	9	928	105,807	0.0	
REALTY INCOME CORP	20	21	1,172	133,647	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	7	12	777	88,602	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	8	8	866	98,677	0.0	
UDR INC	21	21	826	94,211	0.0	
VENTAS INC	27	29	1,941	221,221	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	77	86	971	110,742	0.0	
WEYERHAEUSER CO	65	63	2,080	237,037	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	35	35	4,524	515,519	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	28	28	559	63,742	0.0	
VEREIT INC	75	83	627	71,500	0.0	
DUKE REALTY CORP	28	29	817	93,145	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15	25	485	55,336	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	17	20	717	81,695	0.0	
EQUINIX INC	5	6	2,771	315,792	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	27	30	2,870	327,071	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	30	30	2,001	228,061	0.1	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	44	584	66,617	0.0	
GGP INC	47	47	1,070	121,989	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	62	61	1,083	123,405	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	12	12	508	57,904	0.0	
PUBLIC STORAGE	12	12	2,586	294,751	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	25	26	4,281	487,798	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	14	14	1,336	152,312	0.0	
KIMCO REALTY CORP	34	36	695	79,200	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	11	2,223	253,354	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	892	1,008	53,565	6,103,296	
	銘柄 数 < 比 率 >	35	38	—	< 1.8% >	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	5	5	175	14,547	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	11	12	275	22,863	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		13	13	346	28,774	0.0
小 計		29	31	796	66,185	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		2	3	475	58,853	0.0
KLEPIERRE		18	17	672	83,202	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		8	8	1,978	244,891	0.1
FONCIERE DES REGIONS		2	2	221	27,446	0.0
ICADE		2	3	231	28,625	0.0
ユ ー ロ 計		34	35	3,578	443,019	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		80	83	553	81,270	0.0
HAMMERSON PLC		65	66	394	57,912	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		65	65	734	107,834	0.0
INTU PROPERTIES PLC		78	83	232	34,182	0.0
SEGRO PLC		62	84	417	61,310	0.0
小 計		351	382	2,333	342,510	
	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		285	291	827	69,608	0.0
SCENTRE GROUP		446	452	1,943	163,390	0.0
GPT GROUP		153	147	784	65,957	0.0
MIRVAC GROUP		317	303	690	58,094	0.0
STOCKLAND		202	209	1,004	84,469	0.0
WESTFIELD CORP		165	166	1,488	125,177	0.0
DEXUS		83	84	869	73,108	0.0
GOODMAN GROUP		149	150	1,242	104,518	0.0
小 計		1,803	1,806	8,851	744,323	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		186	190	10,896	159,415	0.0
小 計		186	190	10,896	159,415	
	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		211	217	379	30,725	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		172	184	300	24,306	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		215	218	429	34,713	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		183	194	508	41,158	0.0
小 計		784	815	1,617	130,903	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>	
合 計		4,083	4,269	—	7,989,655	
	銘柄数<比率>	61	64	—	<2.4%>	

(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) 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	4,072	—
		SP/TSE60	228	—
		SWISS IX	204	—
		EURO ST	940	—
		SPI 200	332	—
		FTSE100	442	—

(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

(2017年5月12日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 309,229,876	% 91.9
投資証券	7,989,655	2.4
コール・ローン等、その他	19,418,607	5.7
投資信託財産総額	336,638,138	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (333,541,488千円) の投資信託財産総額 (336,638,138千円) に対する比率は99.1%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=113.94円	1 カナダドル=83.13円	1 ユーロ=123.80円	1 イギリスポンド=146.77円
1 スイスフラン=113.06円	1 スウェーデンクローネ=12.83円	1 ノルウェークローネ=13.25円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=84.09円	1 ニュージーランドドル=77.83円	1 香港ドル=14.63円	1 シンガポールドル=80.91円
1 イスラエルシェゲル=31.58円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	346,680,248,542
コール・ローン等	6,500,298,966
株式(評価額)	309,229,876,905
投資証券(評価額)	7,989,655,718
未収入金	19,062,532,745
未収配当金	619,577,275
差入委託証拠金	3,278,306,933
(B) 負債	13,694,500,515
未払金	10,045,919,306
未払解約金	3,648,576,787
未払利息	4,422
(C) 純資産総額(A-B)	332,985,748,027
元本	137,017,202,778
次期繰越損益金	195,968,545,249
(D) 受益権総口数	137,017,202,778口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,302円

<注記事項>

- ①期首元本額 136,910,588,935円
 期中追加設定元本額 153,902,470,267円
 期中一部解約元本額 153,795,856,424円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,4302円です。

○損益の状況 (2016年5月13日～2017年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,829,457,485
受取配当金	6,817,641,983
受取利息	1,180,645
その他収益金	18,477,805
支払利息	△ 7,842,948
(B) 有価証券売買損益	52,532,465,657
売買益	66,177,694,715
売買損	△ 13,645,229,058
(C) 先物取引等取引損益	1,852,951,795
取引益	2,841,720,945
取引損	△ 988,769,150
(D) 保管費用等	△ 116,996,463
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	61,097,878,474
(F) 前期繰越損益金	133,155,172,459
(G) 追加信託差損益金	178,187,605,623
(H) 解約差損益金	△176,472,111,307
(I) 計(E+F+G+H)	195,968,545,249
次期繰越損益金(I)	195,968,545,249

- (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）	9,941,102,010円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,836,732,618円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,145,144,329円
eMAXIS バランス（波乗り型）	195,449,985円
コアバランス	458,860円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	615,318円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	593,676円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	1,634,211円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	187,851,870円
海外株式セレクション（ラップ向け）	3,225,127円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	18,432,345円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	7,679,239,467円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,377,930,535円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	2,746,833,986円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,656,621,246円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	113,562,512円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	94,246,909円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	781,285,141円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	33,664,211円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴルーキーバー）	3,677,922円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	7,740,970円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	34,005,389円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	36,408,176円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	48,596,190円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	1,078,970,724円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	13,411,940,787円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	263,175,398円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	2,317,023,051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）	49,862,986,580円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	230,407,728円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	89,565,460円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,710,242,579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）	3,112,414,073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）	4,032,731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）	6,975,931,241円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	61,841,575円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	365,112,988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）	1,382,413,011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）	259,970,356円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	123,882,140円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	15,245,041円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	949,629,866円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,940,765,146円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,568,128円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	12,001,808円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	18,323,254円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	19,740,928円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	85,496,025円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	24,640,625円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	180,455,086円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	40,515,958円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	282,957,955円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,198,780,634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）	173,569,383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）	687,145,111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）	642,134,748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）	548,269,657円
合計	137,017,202,778円

新興国株式インデックスマザーファンド

《第8期》決算日2017年5月12日

[計算期間：2016年5月13日～2017年5月12日]

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第8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8期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の株式等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 エマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
4期(2013年5月13日)	19,772	40.8	107,091.73	37.6	98.2	1.7	—	24,079
5期(2014年5月12日)	19,482	△ 1.5	102,729.55	△ 4.1	96.6	3.0	0.4	24,665
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5	35,618
8期(2017年5月12日)	23,115	33.3	113,979.54	30.2	92.6	6.5	0.4	49,734

(注) MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（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 エマージング・マーケット・インデックス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 エマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2016年5月12日	円	%		%	%	%	%
5月末	17,338	—	87,559.17	—	92.8	6.4	0.5
6月末	17,754	2.4	89,601.69	2.3	95.9	3.6	0.5
7月末	16,928	△ 2.4	84,573.19	△ 3.4	93.7	5.6	0.5
8月末	18,303	5.6	91,422.22	4.4	91.4	8.2	0.5
9月末	18,597	7.3	92,750.15	5.9	92.1	7.4	0.4
10月末	18,505	6.7	92,361.79	5.5	95.3	4.2	0.4
11月末	18,994	9.6	94,741.01	8.2	94.4	5.2	0.4
12月末	19,422	12.0	96,509.08	10.2	95.1	4.3	0.4
2017年1月末	20,131	16.1	99,999.91	14.2	96.7	2.7	0.4
2月末	20,882	20.4	103,918.66	18.7	94.4	5.1	0.4
3月末	21,326	23.0	105,842.08	20.9	92.3	7.4	0.4
4月末	21,883	26.2	108,764.50	24.2	90.5	9.0	0.4
5月末	22,056	27.2	109,026.70	24.5	92.1	7.4	0.4
(期 末) 2017年5月12日	23,115	33.3	113,979.54	30.2	92.6	6.5	0.4

(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

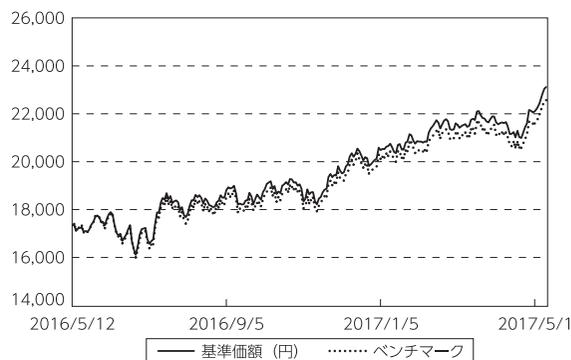
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ33.3%の上昇となりました。

◎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(30.2%)を3.1%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

◎新興国株式市況

- ・米国の保護主義などへの懸念から下落する局面もありましたが、市場でリスク選好の動きが強まるなか、新興国株式市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて4.7%の円安・香港ドル高、15.6%の円安・ブラジルレアル高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に採用されている新興国の株式等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30.2%の上昇となったため、カイ離は3.1%程度となりました。

	組入比率 要 因	銘柄選択 要 因	コ ス ト 要 因	その他の 要 因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.1% 程度	0.1% 程度	△0.1% 程度	3.2% 程度	3.1% 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△0.1%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・不動産投資信託証券（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0.1%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。

◎コスト要因

売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.1%程度でした。

◎その他の要因

その他配当・利子収入等による影響は3.2%程度でした。

◎今後の運用方針

- ・引き続き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

(2016年5月13日～2017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)	(4)	(0.020)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(2)	(0.008)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.016	(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)	(3)	(0.016)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	24	0.122	(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)	(21)	(0.107)	
(そ の 他)	(3)	(0.015)	
合 計	32	0.166	
期中の平均基準価額は、19,565円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年5月13日～2017年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 231,344 (350)	千アメリカドル 14,890 (-)	百株 214,938 (107)	千アメリカドル 3,281 (659)
	メキシコ	7,452 (521)	千メキシコペソ 26,351 (△ 98)	4,613	千メキシコペソ 15,098
	ブラジル	4,499 (1,031)	千ブラジルリアル 9,530 (-)	3,286 (-)	千ブラジルリアル 5,896 (634)
	チリ	25,679 (519)	千チリペソ 257,553 (27)	4,990 (30)	千チリペソ 197,263 (51)
	コロンビア	67 (1)	千コロンビアペソ 114,153 (-)	-	千コロンビアペソ -
	ユーロ ギリシャ	-	千ユーロ -	182	千ユーロ 51
	トルコ	602 (66)	千トルコリラ 511 (-)	875	千トルコリラ 565
	チェコ	440 (53)	千チェココルナ 3,616 (-)	-	千チェココルナ -
	ハンガリー	33	千ハンガリーフォリント 36,854	20	千ハンガリーフォリント 15,651
	ポーランド	167 (42)	千ポーランドズロチ 1,161 (-)	467	千ポーランドズロチ 651
	香港	83,312 (△ 21,920)	千香港ドル 60,957 (△ 153)	56,619	千香港ドル 39,321
	マレーシア	5,148 (497)	千マレーシアリンギット 2,585 (-)	7,918 (-)	千マレーシアリンギット 3,487 (8)
	タイ	10,947 (5,870)	千タイバーツ 38,992 (-)	8,335	千タイバーツ 15,433
	フィリピン	3,787 (68)	千フィリピンペソ 29,297 (-)	1,641	千フィリピンペソ 11,087

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	インドネシア	百株 34,950 (9,588)	千インドネシアルピア 11,367,388 (-)	百株 15,715	千インドネシアルピア 7,140,665
	韓国	670 (149)	千韓国ウォン 5,833,338 (-)	476	千韓国ウォン 5,551,490
	台湾	21,061 (5,868)	千ニュー台湾ドル 131,668 (△ 589)	14,776 (2,439)	千ニュー台湾ドル 83,704 (10,963)
	インド	7,858 (2,575)	千インドルピー 419,225 (-)	3,120	千インドルピー 137,877
	アラブ首長国連邦	2,600 (608)	千アラブディルハム 396 (107)	3,574 (207)	千アラブディルハム 438 (41)
	カタール	- (108)	千カタールリアル - (63)	309 (20)	千カタールリアル 261 (11)
	南アフリカ	2,689 (623)	千南アフリカランド 43,567 (-)	1,940 (1,748)	千南アフリカランド 18,248 (10,866)

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	メキシコ	千口	千メキシコペソ	千口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	20 (-)	730 (△ 293)	9	261
	小 計	20 (-)	730 (△ 293)	9	261
外 国	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	21	573	44	1,063
	REDEFINE PROPERTIES LTD	83	929	30	328
	HYPROP INVESTMENTS LTD	1	217	-	-
	RESILIENT REIT LTD	2	245	1	178
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	- (79)	- (1,221)	-	-
	FORTRESS INCOME FUND LTD	- (67)	- (2,435)	-	-
	小 計	108 (146)	1,966 (3,656)	75	1,571

(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 16,515	百万円 16,219	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

(2016年5月13日～2017年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	7,987,786千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	38,419,120千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

(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

(2016年5月13日～2017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 1,647	百万円 18.8		百万円 1,225	百万円 17.9	%

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

(2017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	
AMBEV SA-ADR	85	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	8	—	—	—	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	20	—	—	—	素材
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	40	—	—	—	エネルギー
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	42	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SINA CORP	—	50	418	47,626	ソフトウェア・サービス
NETEASE INC-ADR	34	70	1,953	222,630	ソフトウェア・サービス
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	114	330	1,789	203,913	小売
INFOSYS LTD-SP ADR	36	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	168	168	210	23,984	素材
BAIDU INC - SPON ADR	117	241	4,502	513,032	ソフトウェア・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	453	436	412	47,049	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	57	119	825	94,044	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP	138	75	262	29,868	素材
BANCO BRADESCO-ADR	38	—	—	—	銀行
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	39	—	—	—	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	—	—	—	エネルギー
SASOL LTD-SPONSORED ADR	11	—	—	—	素材
CREDICORP LTD	59	59	973	110,958	銀行
YY INC-ADR	13	26	144	16,418	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	17	38	488	55,698	消費者サービス
FANG HOLDINGS LTD - ADR	100	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRANSNEFT PJSC	1	1	470	53,625	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	1,011	1,231	247	28,207	各種金融
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	500	500	148	16,864	銀行
GAZPROM PJSC	360	360	82	9,365	エネルギー
RUSHYDRO PJSC	104,640	104,640	167	19,136	公益事業
MMC NORILSK NICKEL PJSC	48	49	729	83,157	素材
LUKOIL PJSC	19	19	96	10,989	エネルギー
TATNEFT PJSC	1,241	1,261	818	93,234	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC	1,020	1,043	567	64,667	エネルギー
VTB BANK PJSC	4,678,200	4,667,800	535	61,029	銀行
SURGUTNEFTGAS OJSC	5,930	6,460	322	36,791	エネルギー
SURGUTNEFTGAS-PREFERENCE	6,337	6,222	337	38,504	エネルギー
SEVERSTAL PJSC	184	184	246	28,102	素材
ROSTELECOM PJSC	650	790	103	11,759	電気通信サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	24	—	—	—	小売
DP WORLD LTD	146	146	328	37,480	運輸
ALROSA PJSC	1,597	2,207	363	41,374	素材
JD.COM INC-ADR	151	600	2,385	271,815	小売
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	171	363	524	59,806	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	431	995	11,955	1,362,257	ソフトウェア・サービス
WEIBO CORP-SPON ADR	—	29	181	20,691	ソフトウェア・サービス
58.COM INC-ADR	31	74	320	36,543	ソフトウェア・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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
YUM CHINA HOLDINGS INC	—	352	1,207	137,566	消費者サービス	
INTER RAO UES PJSC	—	25,000	176	20,166	公益事業	
SAMSUNG ELECTR-GDR	0.8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HON HAI PRECISION-GDR REG S	104	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	8	—	—	—	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	422	352	1,744	198,754	エネルギー	
GAZPROM PAO -SPON ADR	4,945	4,550	2,062	235,054	エネルギー	
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	143	155	79	9,059	電気通信サービス	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	79	80	956	109,017	エネルギー	
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	620	—	—	—	電気通信サービス	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	226	272	959	109,313	食品・生活必需品小売り	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	2,126	2,213	2,709	308,742	銀行	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	1,044	814	341	38,860	銀行	
MEGAFON-REG S GDR	82	—	—	—	電気通信サービス	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	—	77	111	12,715	素材	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	420	756	117	13,411	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,814,567 56	4,831,218 43	43,385 —	4,943,296 <9.9%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ			
ALFA S. A. B. -A	2,474	2,406	6,402	38,734	資本財	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	503	503	4,377	26,484	資本財	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	27,316	29,470	42,377	256,386	電気通信サービス	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,339	1,388	5,581	33,765	家庭用品・パーソナル用品	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	4,574	4,658	19,982	120,896	食品・生活必需品小売り	
CEMEX SAB-CPO	12,234	12,939	21,234	128,465	素材	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	2,133	2,168	20,231	122,402	メディア	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,449	1,413	6,540	39,571	食品・飲料・タバコ	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,177	2,220	23,936	144,813	銀行	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,603	1,631	28,018	169,514	食品・飲料・タバコ	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	118	126	5,583	33,777	素材	
MEXICHEM SAB DE CV-*	906	982	5,077	30,716	素材	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	437	449	6,305	38,149	食品・飲料・タバコ	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	3,329	3,374	18,213	110,190	素材	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	2,044	1,997	6,546	39,604	銀行	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	268	296	5,983	36,197	運輸	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	353	381	5,121	30,987	食品・飲料・タバコ	
GENERA SAB DE CV	921	901	2,903	17,568	各種金融	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	165	165	2,367	14,324	小売	
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,613	1,613	5,506	33,316	銀行	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	186	186	6,832	41,334	運輸	
OHL MEXICO SAB DE CV	670	670	1,507	9,120	運輸	
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	290	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	217	242	4,936	29,863	運輸	
GRUMA S. A. B. -B	171	191	4,674	28,283	食品・飲料・タバコ	
GRUPO LALA SAB DE CV	552	552	1,988	12,032	食品・飲料・タバコ	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	—	480	4,143	25,070	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	68,043 26	71,404 26	266,375 —	1,611,570 <3.2%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル			
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	663	663	587	21,310	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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	201	201	420	15,255	公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,389	3,490	5,172	187,646	エネルギー
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	292	292	874	31,728	公益事業
GERDAU SA-PREF	729	809	806	29,262	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	91	91	257	9,326	公益事業
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	343	397	1,891	68,616	電気通信サービス
VALE SA-PREF	1,708	1,704	4,246	154,058	素材
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,609	2,865	11,391	413,295	銀行
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	101	112	415	15,062	エネルギー
BRF SA	573	541	2,396	86,949	食品・飲料・タバコ
JBS SA	615	621	701	25,458	食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA	147	157	546	19,821	家庭用品・パーソナル用品
VALE SA	1,082	1,142	3,005	109,048	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	316	321	2,401	87,111	エネルギー
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	144	144	490	17,804	公益事業
PORTO SEGURO SA	104	104	313	11,387	保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,547	2,645	4,052	147,011	エネルギー
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	139	139	1,017	36,899	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S. A.	563	627	1,837	66,650	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	494	654	1,160	42,107	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	3,409	3,526	3,621	131,379	銀行
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	202	260	352	12,800	公益事業
EDP-ENERGIAS DO BRASIL-RTS	55	—	—	—	公益事業
EMBRAER SA	586	586	925	33,569	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	—	180	314	11,395	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	549	549	411	14,938	素材
CPFL ENERGIA SA	171	185	482	17,508	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	170	—	—	—	公益事業
CCR SA	778	1,050	1,905	69,140	運輸
BM&FBOVESPA SA	1,511	1,838	3,679	133,486	各種金融
B2W CIA DIGITAL	112	—	—	—	小売
BRASKEM SA-PREF A	128	134	457	16,587	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	2,461	2,714	8,587	311,554	銀行
BANCO DO BRASIL S. A.	756	762	2,620	95,072	銀行
CIELO SA	890	1,263	3,049	110,631	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	369	369	1,020	37,015	銀行
DURATEX SA	258	258	223	8,124	素材
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	310	355	444	16,112	素材
FIBRIA CELULOSE SA	222	222	625	22,704	素材
HYPERMARCAS SA	309	309	972	35,279	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO BRADESCO S. A.	657	816	2,480	89,987	銀行
WEG SA	488	484	953	34,579	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	508	584	789	28,650	不動産
LOCALIZA RENT A CAR	133	152	726	26,347	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	67	73	518	18,803	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	150	173	308	11,203	保険
TIM PARTICIPACOES SA	749	749	763	27,691	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	190	200	1,383	50,197	食品・生活必需品小売り
M DIAS BRANCO SA	30	90	522	18,938	食品・飲料・タバコ
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	199	—	—	—	各種金融

銘柄	株数	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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円		
ODONTOPREV S. A.	220	245	292	10,621		ヘルスケア機器・サービス
TOTVS SA	109	—	—	—		ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	160	175	922	33,459		公益事業
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	91	—	—	—		公益事業
ESTACIO PARTICIPACOES SA	240	—	—	—		消費者サービス
LOJAS AMERICANAS SA	150	150	219	7,972		小売
QUALICORP SA	184	202	500	18,174		ヘルスケア機器・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	1,215	1,194	1,876	68,062		消費者サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	614	620	1,886	68,448		保険
AMBEV SA	4,026	4,191	8,185	296,952		食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	477	476	750	27,233		素材
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	700	—	—	—		運輸
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	—	141	189	6,870		公益事業
RUMO SA	—	700	693	25,167		運輸
小 計	株 数 ・ 金 額	41,461	43,705	97,642	3,542,476	
	銘柄 数 < 比 率 >	62	57	—	< 7.1% >	
(チリ)			千チリペソ			
BANCO DE CREDITO E INVERSION	32	32	122,475	20,759		銀行
CENCOSUD SA	1,121	1,226	234,242	39,704		食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA	1,074	1,061	167,069	28,318		素材
COLBUN SA	7,017	7,017	108,648	18,415		公益事業
EMPRESAS COPEC SA	400	388	292,120	49,514		エネルギー
ITAU CORPBANCA	125,500	141,923	89,397	15,152		銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	98	129	98,050	16,619		電気通信サービス
S. A. C. I. FALABELLA	426	524	282,725	47,921		小売
AES GENER SA	2,201	2,201	54,752	9,280		公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A	2,210	2,393	92,417	15,664		公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	255	274	226,280	38,354		運輸
ENEL GENERACION CHILE SA	2,881	2,881	153,937	26,092		公益事業
BANCO SANTANDER CHILE	58,371	58,371	234,421	39,734		銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	85	85	198,377	33,624		素材
ENEL AMERICAS SA	17,259	24,759	322,019	54,582		公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	132	132	115,426	19,564		食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE	20,658	20,782	172,265	29,198		銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	220	220	57,728	9,784		食品・飲料・タバコ
SONDA SA	400	—	—	—		ソフトウェア・サービス
ENDESA AMERICAS SA	2,881	—	—	—		公益事業
ENEL CHILE SA	17,259	17,259	128,081	21,709		公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	260,486	281,663	3,150,435	533,998	
	銘柄 数 < 比 率 >	21	19	—	< 1.1% >	
(コロンビア)			千コロンビアペソ			
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	2,954	2,954	354,504	13,790		銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	376	398	1,252,108	48,707		銀行
ECOPETROL SA	3,983	3,983	547,690	21,305		エネルギー
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	67	68	202,415	7,873		各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA	333	333	408,924	15,907		公益事業
GRUPO ARGOS SA	258	258	538,512	20,948		素材
GRUPO DE INV SURAMERICANA	206	206	815,280	31,714		各種金融
CEMENTOS ARGOS SA	348	393	482,921	18,785		素材

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	
(コロンビア)					
GRUPO DE INV. SURAMERICANA-PF	百株 85	百株 85	千コロンビアペソ 326,699	千円 12,708	各種金融
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,612 9	8,681 9	4,929,054 -	191,740 <0.4%>
(ユーロ…ギリシャ)			千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	217	217	215	26,728	電気通信サービス
ALPHA BANK AE	1,224	1,142	261	32,375	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE	4,665	4,665	157	19,464	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA	1,598	1,598	149	18,565	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.	38	38	99	12,297	素材
PIRAEUS BANK S.A	5,815	5,815	142	17,639	銀行
PUBLIC POWER CORP	100	-	-	-	公益事業
OPAP SA	192	192	187	23,235	消費者サービス
FF GROUP	27	27	55	6,909	小売
JUMBO SA	91	91	146	18,163	小売
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,971 10	13,789 9	1,416 -	175,380 <0.4%>
(トルコ)			千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	1,931	1,897	1,754	55,910	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	1,358	1,438	993	31,668	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI	2,026	2,069	1,934	61,642	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	775	775	901	28,723	電気通信サービス
YAPI VE KREDI BANKASI	745	745	317	10,111	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	182	182	367	11,709	食品・飲料・タバコ
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	107	113	1,043	33,232	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING	804	804	849	27,063	各種金融
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,219	1,219	800	25,492	素材
KOC HOLDING AS	559	559	940	29,977	資本財
ARCELIK AS	211	211	494	15,755	耐久消費財・アパレル
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	558	602	280	8,951	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	64	64	256	8,187	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO	474	474	308	9,831	運輸
ULKER BISKUVI SANAYI	127	127	266	8,497	食品・飲料・タバコ
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	110	110	317	10,106	自動車・自動車部品
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	656	656	392	12,511	銀行
COCA-COLA ICECEK AS	64	64	230	7,340	食品・飲料・タバコ
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	140	140	226	7,230	運輸
TURKIYE HALK BANKASI	538	538	640	20,412	銀行
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	451	-	-	-	資本財
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	384	384	240	7,646	電気通信サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	186	186	1,180	37,603	食品・生活必需品小売り
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	522	627	340	10,847	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,199 24	13,992 23	15,080 -	480,451 <1.0%>
(チェコ)			千チェココルナ		
O2 CZECH REPUBLIC AS	56	56	1,520	7,083	電気通信サービス
CEZ AS	141	141	6,132	28,578	公益事業
KOMERCNI BANKA AS	13	67	6,535	30,457	銀行
MONETA MONEY BANK AS	-	440	3,559	16,587	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	211 3	705 4	17,748 -	82,707 <0.2%>

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	
(ハンガリー)					
RICHTER GEDEON NYRT	123	123	85,624	34,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTP BANK PLC	208	213	175,725	70,131	銀行
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	32	40	90,801	36,238	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	363 3	376 3	352,150 —	140,543 <0.3%>
(ポーランド)					
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	281	282	3,201	93,813	エネルギー
ORANGE POLSKA SA	572	572	262	7,681	電気通信サービス
PKO BANK POLSKI SA	765	769	2,724	79,826	銀行
BANK PEKAO SA	115	138	1,984	58,148	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	122	122	1,415	41,465	素材
BANK ZACHODNI WBK SA	30	30	1,084	31,784	銀行
MBANK SA	13	13	582	17,061	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,563	1,563	1,022	29,950	エネルギー
GRUPA LOTOS SA	78	78	453	13,301	エネルギー
EUROCASH SA	71	71	227	6,656	食品・生活必需品小売り
BANK MILLENNIUM SA	520	520	374	10,969	銀行
CYFROWY POLSAT SA	163	163	422	12,369	メディア
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	29	29	222	6,524	銀行
PGE SA	741	741	927	27,189	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	491	491	2,163	63,381	保険
TAURON POLSKA ENERGIA SA	959	959	332	9,754	公益事業
ENEA SA	190	—	—	—	公益事業
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	—	40	306	8,983	素材
SYNTHOS SA	430	430	234	6,866	素材
GRUPA AZOTY SA	37	37	254	7,443	素材
ALIOR BANK SA	42	78	572	16,786	銀行
ENERGA SA	175	—	—	—	公益事業
LPP SA	1	1	706	20,709	耐久消費財・アパレル
CCC SA	20	23	496	14,556	耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	7,413 23	7,154 22	19,973 —	585,224 <1.2%>
(香港)					
PETROCHINA CO LTD-H	18,430	18,770	9,966	145,815	エネルギー
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	22,240	22,660	14,139	206,865	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	5,240	5,300	5,448	79,710	電気通信サービス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	820	820	1,771	25,912	ソフトウェア・サービス
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	2,600	2,620	3,453	50,519	自動車・自動車部品
CITIC LTD	3,820	3,880	4,446	65,052	資本財
CNOOC LTD	15,580	15,870	14,298	209,192	エネルギー
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,520	1,720	1,007	14,745	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	2,970	3,010	1,306	19,111	素材
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,340	1,340	1,541	22,544	運輸
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,220	1,320	1,244	18,210	運輸
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,080	1,420	2,627	38,433	食品・飲料・タバコ
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,740	1,740	1,771	25,914	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	440	440	1,073	15,706	資本財
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,020	1,120	2,441	35,720	運輸
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,580	1,440	1,264	18,497	運輸
BYD CO LTD-H	565	545	2,387	34,923	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	12,160	12,320	4,681	68,491	電気通信サービス
DATANG INTL POWER GEN CO-H	2,360	—	—	—	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	455	455	1,694	24,796	資本財
CHINA EVERBRIGHT LTD	800	780	1,350	19,764	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	1,080	1,080	1,188	17,380	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,520	1,700	926	13,554	運輸
CHINA MOBILE LTD	5,350	5,445	46,418	679,104	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	3,720	3,720	2,157	31,565	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,360	—	—	—	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,090	1,090	2,719	39,787	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	3,640	3,760	4,218	61,719	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	6,320	6,260	3,092	45,242	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,422	1,422	2,841	41,566	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	320	320	1,065	15,589	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	1,590	1,870	680	9,958	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,420	3,420	1,217	17,812	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,880	1,880	964	14,109	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	4,020	4,100	5,272	77,138	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	6,500	6,590	16,046	234,762	保険
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	23,390	2,349	2,139	31,307	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,700	1,700	2,444	35,764	公益事業
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	3,150	—	—	—	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,420	2,380	3,565	52,159	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,545	4,625	21,113	308,885	保険
AIR CHINA LTD-H	1,540	1,680	1,192	17,450	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	3,930	3,930	2,495	36,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,600	1,600	1,076	15,753	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	4,504	5,040	128,318	1,877,298	ソフトウェア・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	7,669	7,599	4,468	65,369	銀行
ZTE CORP-H	631	631	919	13,447	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	4,880	4,780	1,223	17,902	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	73,315	74,625	47,461	694,366	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	876	876	1,054	15,430	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	490	490	2,601	38,065	耐久消費財・アパレル
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,890	2,890	838	12,261	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,400	2,400	2,049	29,985	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	2,540	2,540	904	13,229	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,980	3,030	5,478	80,146	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,360	1,510	1,363	19,948	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,170	1,050	1,207	17,665	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,720	1,720	1,032	15,098	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	69,220	70,460	26,633	389,653	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	2,190	2,190	2,198	32,167	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,200	1,100	1,313	19,215	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	645	655	6,510	95,251	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,020	3,465	7,104	103,935	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	64,313	65,393	33,350	487,920	銀行
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	660	680	2,879	42,131	公益事業
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	2,080	2,080	988	14,454	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,870	3,920	4,272	62,511	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA COAL ENERGY CO-H	2,440	1,860	647	9,469	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,440	3,400	7,480	109,432	不動産
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	7,150	7,920	3,872	56,660	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	860	950	2,052	30,020	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,520	3,520	2,347	34,348	資本財
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	10,080	11,280	1,161	16,997	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	640	630	3,654	53,458	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,420	2,460	5,079	74,318	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,740	1,740	1,927	28,205	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	2,480	2,440	2,781	40,694	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,840	2,215	2,609	38,173	資本財
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	2,880	2,480	905	13,243	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,480	2,480	1,145	16,762	素材
SHUI ON LAND LTD	3,276	—	—	—	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	824	824	1,036	15,165	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	2,270	—	—	—	運輸
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	4,080	5,490	3,321	48,592	耐久消費財・アパレル
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,120	5,050	2,716	39,748	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,860	2,860	1,990	29,121	エネルギー
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	5,032	4,732	3,591	52,548	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	780	780	2,035	29,783	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,720	1,930	814	11,915	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	3,860	3,860	2,273	33,261	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,700	4,750	5,386	78,804	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,830	2,830	1,681	24,593	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING-H	5,151	5,111	3,894	56,977	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,300	2,346	6,709	98,160	保険
CRRC CORP LTD - H	3,845	3,655	2,690	39,361	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	455	480	1,958	28,651	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	20,150	21,800	7,891	115,454	銀行
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,640	3,640	3,024	44,253	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,906	1,846	2,363	34,582	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	1,044	1,040	3,546	51,883	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,540	1,540	1,931	28,252	公益事業
LONGFOR PROPERTIES	1,295	1,295	1,696	24,819	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	—	640	4,211	61,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	11,100	11,950	1,135	16,608	半導体・半導体製造装置
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2,745	2,745	2,261	33,091	自動車・自動車部品
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	3,220	3,220	759	11,117	不動産
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,560	1,560	2,159	31,586	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,900	1,865	2,924	42,782	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,130	2,130	1,469	21,501	食品・生活必需品小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,590	1,740	1,301	19,041	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	2,270	2,270	1,166	17,069	銀行
YUEXIU PROPERTY CO LTD	5,700	—	—	—	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,110	1,110	2,042	29,880	耐久消費財・アパレル
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	600	600	1,284	18,784	ヘルスケア機器・サービス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,836	2,644	3,368	49,280	各種金融
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	474	—	—	—	資本財
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,680	1,680	1,720	25,168	不動産

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		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	688	688	2,789	40,815	保険	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	5,810	6,160	1,989	29,109	保険	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,340	3,660	980	14,350	公益事業	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	2,925	2,605	1,779	26,029	各種金融	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	930	1,100	1,540	22,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	335	375	1,140	16,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	530	590	1,130	16,538	資本財	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	1,105	1,105	830	12,156	資本財	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	3,440	3,720	156	2,285	食品・飲料・タバコ	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,600	9,600	3,753	54,915	半導体・半導体製造装置	
KINGSOFT CORP LTD	730	670	1,467	21,466	ソフトウェア・サービス	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	7,740	7,740	2,275	33,291	各種金融	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,190	1,190	1,775	25,975	資本財	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,040	3,000	984	14,395	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,880	2,880	1,013	14,831	銀行	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,163	1,163	2,296	33,601	不動産	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	8,900	10,000	1,260	18,433	メディア	
CGN POWER CO LTD-H	7,910	9,090	2,136	31,251	公益事業	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	517	—	—	—	不動産	
LUYE PHARMA GROUP LTD	1,170	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GF SECURITIES CO LTD-H	1,164	1,154	1,841	26,945	各種金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,290	1,290	1,857	27,176	各種金融	
3SBIO INC	—	940	975	14,274	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAR INC	680	—	—	—	運輸	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	—	400	1,104	16,151	自動車・自動車部品	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	—	5,600	1,870	27,363	各種金融	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	—	5,800	1,960	28,680	不動産	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	—	18,000	257	3,765	耐久消費財・アパレル	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	690	690	683	9,993	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額	665,443	670,216	646,805	9,462,760	
	銘柄数<比率>	140	136	—	<19.0%>	
(マレーシア)				千マレーシアリンギット		
GENTING MALAYSIA BHD	2,609	2,689	1,586	41,598	消費者サービス	
GENTING BHD	1,967	2,039	1,983	52,019	消費者サービス	
TELEKOM MALAYSIA BHD	969	1,028	661	17,331	電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL BHD	2,959	2,987	4,157	109,020	公益事業	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	367	390	969	25,421	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	4,257	3,093	2,879	75,502	銀行	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	552	552	154	4,044	消費者サービス	
IOI CORP BHD	2,569	1,994	921	24,154	食品・飲料・タバコ	
AMMB HOLDINGS BHD	1,720	1,657	921	24,156	銀行	
YTL CORP BHD	3,872	3,872	580	15,231	公益事業	
GAMUDA BHD	1,460	1,540	823	21,602	資本財	
MISC BHD	985	985	730	19,163	運輸	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,600	3,600	2,127	55,785	銀行	
PETRONAS GAS BHD	610	626	1,196	31,383	公益事業	
SIME DARBY BERHAD	2,714	2,063	1,924	50,467	資本財	
PUBLIC BANK BERHAD	2,114	2,114	4,219	110,636	銀行	
UMW HOLDINGS BHD	490	490	287	7,541	自動車・自動車部品	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	111	126	579	15,197	食品・飲料・タバコ	

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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円		
RHB CAPITAL BHD	544	—	—	—	—	銀行
PPB GROUP BERHAD	406	435	739	19,389	19,389	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD	2,688	2,529	900	23,606	23,606	資本財
DIGI.COM BHD	3,068	3,178	1,614	42,330	42,330	電気通信サービス
MAXIS BHD	1,647	1,647	1,080	28,328	28,328	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	2,331	2,331	1,237	32,454	32,454	電気通信サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,620	1,910	292	7,662	7,662	公益事業
HONG LEONG BANK BERHAD	580	580	813	21,321	21,321	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,459	2,169	1,587	41,629	41,629	素材
LAFARGE MALAYSIA BHD	335	335	218	5,718	5,718	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	214	184	446	11,713	11,713	エネルギー
AIRASIA BHD	1,000	1,400	490	12,847	12,847	運輸
BUMI ARMADA BERHAD	2,055	—	—	—	—	エネルギー
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	920	920	409	10,734	10,734	銀行
SAPURA ENERGY BHD	2,957	3,578	686	18,012	18,012	エネルギー
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	738	692	559	14,660	14,660	運輸
FELDA GLOBAL VENTURES	1,020	1,201	228	5,983	5,983	食品・飲料・タバコ
IHH HEALTHCARE BHD	2,160	2,912	1,802	47,262	47,262	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	208	208	368	9,674	9,674	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	497	497	442	11,610	11,610	資本財
GENTING PLANTATIONS BHD	195	195	226	5,941	5,941	食品・飲料・タバコ
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,377	1,377	375	9,856	9,856	メディア
WESTPORTS HOLDINGS BHD	932	932	363	9,530	9,530	運輸
DIALOG GROUP BHD	3,482	2,921	558	14,632	14,632	エネルギー
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,328	1,728	373	9,786	9,786	不動産
HARTALEGA HOLDINGS BHD	601	601	342	8,982	8,982	ヘルスケア機器・サービス
RHB BANK BHD	—	709	390	10,231	10,231	銀行
小計	株数・金額	69,289	67,016	43,255	1,134,159	
	銘柄数<比率>	44	43	—	<2.3%>	
(タイ)				千タイバート		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,196	1,196	7,265	23,831	23,831	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR	1,537	1,562	29,599	97,087	97,087	銀行
TMB BANK PCL-NVDR	11,100	11,100	2,464	8,082	8,082	銀行
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	830	830	1,618	5,308	5,308	メディア
CP ALL PCL-NVDR	3,858	4,248	27,399	89,870	89,870	食品・生活必需品小売り
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	222	222	4,029	13,216	13,216	銀行
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	915	927	16,732	54,882	54,882	電気通信サービス
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,364	1,565	24,414	80,077	80,077	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	358	352	18,048	59,197	59,197	素材
PTT PCL-NVDR	875	887	34,238	112,301	112,301	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,226	1,226	11,647	38,202	38,202	エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	377	3,700	15,447	50,667	50,667	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	860	1,370	2,452	8,043	8,043	エネルギー
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,640	2,388	5,970	19,581	19,581	食品・飲料・タバコ
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,200	1,200	4,350	14,268	14,268	素材
IRPC PCL - NVDR	8,980	8,980	4,849	15,905	15,905	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,771	1,871	13,475	44,199	44,199	素材
THAI OIL PCL-NVDR	692	692	5,293	17,363	17,363	エネルギー
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,940	3,180	5,946	19,504	19,504	銀行
GLOW ENERGY PCL - NVDR	435	435	3,436	11,271	11,271	公益事業

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	
(タイ)	百株	百株		千タイバーツ	千円	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	3,406	3,406	6,948	22,790	ヘルスケア機器・サービス	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,652	1,652	3,419	11,216	食品・飲料・タバコ	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	3,320	3,320	3,253	10,671	小売	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	—	127	2,667	8,747	公益事業	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,920	5,320	4,442	14,570	運輸	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	316	316	5,782	18,967	ヘルスケア機器・サービス	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	430	430	4,085	13,398	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRUE CORP PCL-NVDR	7,562	9,108	5,784	18,971	電気通信サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,521	1,956	7,286	23,898	消費者サービス	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	—	1,000	4,375	14,350	資本財	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	970	970	2,643	8,669	エネルギー	
KCE ELECTRONICS - NVDR	—	260	2,886	9,466	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROBINSON PCL-NVDR	—	459	2,822	9,258	小売	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	6,040	5,740	4,161	13,649	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	73,514	81,996	299,235	981,492	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	34	—	< 2.0% >	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
PLDT INC	85	88	15,205	34,667	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC	7,265	7,365	23,678	53,986	不動産	
AYALA LAND INC	6,453	6,502	25,617	58,408	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	660	660	6,943	15,830	銀行	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	450	450	4,214	9,608	運輸	
MEGAWORLD CORP	9,990	9,990	4,175	9,520	不動産	
JOLLIBEE FOODS CORP	379	379	8,081	18,425	消費者サービス	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	8,000	8,000	4,720	10,761	公益事業	
SM INVESTMENTS CORP	137	217	16,805	38,315	資本財	
AYALA CORPORATION	189	218	18,991	43,301	各種金融	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,677	1,771	13,513	30,810	資本財	
ABOITIZ POWER CORP	1,321	1,321	5,356	12,213	公益事業	
METROPOLITAN BANK & TRUST	265	541	4,571	10,422	銀行	
BDO UNIBANK INC	1,436	1,741	21,197	48,330	銀行	
DMCI HOLDINGS INC	3,536	3,536	4,653	10,609	資本財	
UNIVERSAL ROBINA CORP	763	763	12,793	29,169	食品・飲料・タバコ	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,820	1,820	2,573	5,867	資本財	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,197	2,538	21,197	48,329	資本財	
GLOBE TELECOM INC	28	30	6,162	14,049	電気通信サービス	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	11,200	12,027	7,901	18,015	各種金融	
SECURITY BANK CORP	—	109	2,380	5,427	銀行	
ROBINSONS LAND CO	1,450	1,450	3,472	7,917	不動産	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	69	69	8,702	19,842	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額	59,374	61,589	242,909	553,834	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	23	—	< 1.1% >	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT	18,261	18,161	2,860,357	24,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	44,027	44,839	19,594,643	168,513	電気通信サービス	
INDOFOOD SUKSES MAKMRU TBK P	3,782	3,782	3,176,880	27,321	食品・飲料・タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	328	8,200	3,124,200	26,868	食品・飲料・タバコ	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	10,750	10,946	19,620,705	168,738	銀行	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,272	1,272	2,133,780	18,350	素材	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	17,669	17,967	15,451,620	132,883	自動車・自動車部品	

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		
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシアルピア	千円		
GIUDANG GARAM TBK PT	415	415	2,945,462	25,330	食品・飲料・タバコ	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	9,698	9,839	13,750,002	118,250	銀行	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	340	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	2,810	2,810	1,382,520	11,889	銀行	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,554	2,554	2,209,210	18,999	素材	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	9,575	9,575	2,326,725	20,009	公益事業	
UNITED TRACTORS TBK PT	1,433	1,503	3,765,015	32,379	エネルギー	
LIPPO KARAWACI TBK PT	17,464	17,464	1,388,388	11,940	不動産	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	8,177	8,265	9,938,662	85,472	銀行	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,342	1,323	6,132,105	52,736	家庭用品・パーソナル用品	
ADARO ENERGY TBK PT	12,400	12,400	1,853,800	15,942	エネルギー	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,700	1,700	795,600	6,842	運輸	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	6,606	6,606	4,343,445	37,353	銀行	
AKR CORPORINDO TBK PT	1,543	1,543	979,805	8,426	資本財	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	6,403	6,403	1,965,721	16,905	食品・飲料・タバコ	
XL AXIATA TBK PT	2,450	3,200	1,008,000	8,668	電気通信サービス	
PAKUWON JATI TBK PT	—	19,000	1,197,000	10,294	不動産	
SUMMARECON AGUNG TBK PT	8,500	8,500	1,134,750	9,758	不動産	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	4,402	4,402	889,204	7,647	メディア	
BUMI SERPONG DAMAI PT	7,017	7,017	1,234,992	10,620	不動産	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	990	1,980	1,722,600	14,814	食品・飲料・タバコ	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,756	2,126	1,222,450	10,513	電気通信サービス	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	5,000	5,000	1,420,000	12,212	メディア	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	5,800	—	—	—	メディア	
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	—	4,365	982,125	8,446	資本財	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	2,057	2,187	3,182,085	27,365	小売	
小 計	株 数	金 額	216,521	245,344	133,731,853	1,150,093
	銘柄 数 < 比 率 >		31	31	—	< 2.3% >
(韓国)			千韓国ウォン			
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	96	87	19,858,475	2,015,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	224	229	986,706	100,150	公益事業	
SHINSEGAE INC	6	6	137,592	13,965	小売	
CJ CORP	12	12	260,295	26,419	資本財	
SK TELECOM	17	17	416,364	42,260	電気通信サービス	
HYUNDAI MOTOR CO	140	137	2,170,350	220,290	自動車・自動車部品	
POSCO	60	65	1,777,185	180,384	素材	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	52	49	382,980	38,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KT CORP	22	22	70,537	7,159	電気通信サービス	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	49	58	217,810	22,107	各種金融	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	59	60	1,512,500	153,518	自動車・自動車部品	
CHEL WORLDWIDE INC	72	61	117,348	11,910	メディア	
KB FINANCIAL GROUP INC	337	353	1,906,982	193,558	銀行	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	31	29	822,967	83,531	保険	
SAMSUNG SDI CO LTD	48	48	730,350	74,130	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	372	379	1,927,352	195,626	銀行	
LG ELECTRONICS INC	93	94	750,997	76,226	耐久消費財・アパレル	
AMOREPACIFIC GROUP	24	24	382,642	38,838	家庭用品・パーソナル用品	
HYUNDAI DEPT STORE CO	13	13	144,160	14,632	小売	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	24	24	199,823	20,282	資本財	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	41	46	139,150	14,123	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
KT&G CORP	96	104	1,124,280	114,114	食品・飲料・タバコ
NCSOFT CORP	15	15	570,400	57,895	ソフトウェア・サービス
LG DISPLAY CO LTD	203	206	612,117	62,129	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	36	27	474,201	48,131	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	130	225	259,095	26,298	資本財
AMOREPACIFIC CORP	28	28	1,036,070	105,161	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	258	264	1,135,200	115,222	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	50	50	232,000	23,548	資本財
LG CHEM LTD	40	40	1,167,695	118,521	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	41	41	98,810	10,029	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	8	8	823,680	83,603	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	56	57	999,940	101,493	エネルギー
KAKAO CORP	25	27	264,656	26,862	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	35	35	190,750	19,361	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	9	10	72,975	7,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	47	46	517,140	52,489	耐久消費財・アパレル
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	66	—	—	—	各種金融
S-1 CORPORATION	16	16	172,425	17,501	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORP	230	234	865,606	87,859	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	508	517	2,920,956	296,477	半導体・半導体製造装置
LG CORP	83	82	584,330	59,309	資本財
HYUNDAI STEEL CO	70	70	394,856	40,077	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	16	15	2,683,758	272,401	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	14	14	119,480	12,127	素材
HANWHA TECHWIN CO LTD	—	34	174,420	17,703	資本財
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	245	220	283,471	28,772	銀行
KANGWON LAND INC	103	103	400,804	40,681	消費者サービス
NAVER CORP	24	24	2,159,804	219,220	ソフトウェア・サービス
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	160	359	329,226	33,416	各種金融
CELLTRION INC	60	74	705,791	71,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	22	25	119,085	12,087	公益事業
LG UPLUS CORP	188	188	254,205	25,801	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	9	9	247,040	25,074	小売
YUHAN CORP	6	7	172,885	17,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGBU INSURANCE CO LTD	37	43	302,993	30,753	保険
S-OIL CORP	38	38	414,090	42,030	エネルギー
KCC CORP	5	5	181,537	18,426	資本財
POSCO DAEWOO CORP	41	41	100,332	10,183	資本財
SAMSUNG CARD CO	30	30	131,170	13,313	各種金融
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	27	33	339,275	34,436	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	68	63	310,803	31,546	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	30	39	124,662	12,653	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	69	61	716,475	72,722	保険
LOTTE CHEMICAL CORP	13	13	472,500	47,958	素材
GS HOLDINGS	45	45	269,100	27,313	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C	121	121	168,732	17,126	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP	92	92	251,217	25,498	素材
HYOSUNG CORPORATION	19	18	276,575	28,072	素材
HANWHA CORPORATION	40	40	169,823	17,237	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP	6	6	249,516	25,325	食品・飲料・タバコ

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		
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円		
BNK FINANCIAL GROUP INC	230	230	228,259	23,168	銀行	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	16	16	248,745	25,247	運輸	
DGB FINANCIAL GROUP INC	143	143	174,460	17,707	銀行	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	18	18	179,265	18,195	自動車・自動車部品	
KOREA ZINC CO LTD	7	7	319,232	32,402	素材	
E-MART INC	18	17	388,170	39,399	食品・生活必需品小売り	
HYUNDAI WIA CORP	13	13	93,547	9,495	自動車・自動車部品	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	11	15	117,335	11,909	素材	
DOOSAN CORP	6	—	—	—	資本財	
SK HOLDINGS CO LTD	30	40	997,530	101,249	資本財	
ORION CORP	3	3	230,640	23,409	食品・飲料・タバコ	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	55	55	212,040	21,522	保険	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	51	61	399,063	40,504	資本財	
SK NETWORKS CO LTD	97	97	72,847	7,393	資本財	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.51	5	111,180	11,284	食品・飲料・タバコ	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	193	193	124,484	12,635	保険	
LG INNOTEK CO LTD	12	12	170,730	17,329	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	6	7	133,125	13,512	素材	
HANKOOK TIRE CO LTD	65	65	412,462	41,864	自動車・自動車部品	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	89	117	90,558	9,191	資本財	
HANON SYSTEMS	159	171	162,450	16,488	自動車・自動車部品	
CJ E&M CORP	17	17	143,620	14,577	メディア	
DONGSUH COMPANIES INC	29	29	93,870	9,527	食品・生活必需品小売り	
PARADISE CO LTD	37	—	—	—	消費者サービス	
CJ KOREA EXPRESS CORP	5	5	106,720	10,832	運輸	
HOTEL SHILLA CO LTD	29	29	172,533	17,512	小売	
HANSSEM CO LTD	8	9	213,180	21,637	耐久消費財・アパレル	
WOORI BANK	291	267	437,967	44,453	銀行	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	20	20	116,484	11,823	商業・専門サービス	
SAMSUNG SDS CO LTD	27	30	443,975	45,063	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG C&T CORP	66	66	844,893	85,756	資本財	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7	8	175,365	17,799	家庭用品・パーソナル用品	
HANMI PHARM CO LTD	4	4	186,445	18,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BGF RETAIL CO LTD	7	17	214,890	21,811	食品・生活必需品小売り	
GS RETAIL CO LTD	23	23	135,486	13,751	食品・生活必需品小売り	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.54	0.54	94,716	9,613	食品・飲料・タバコ	
OTTOGI CORPORATION	1	1	84,000	8,526	食品・飲料・タバコ	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	—	1	119,320	12,110	家庭用品・パーソナル用品	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	—	15	277,500	28,166	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SY	—	1	48,840	4,957	資本財	
HYUNDAI CONSTRUCTION EQUIPME	—	1	40,885	4,149	資本財	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	—	5	222,425	22,576	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数	金 額	7,213	7,556	70,597,762	7,165,672
銘柄 数 < 比 率 >	107	110	—	<14.4%>		
(台湾)			千ニュー台湾ドル			
COMPAL ELECTRONICS	3,747	3,747	7,514	28,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	1,702	1,742	29,878	112,642	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	2,831	2,831	6,851	25,831	資本財	
FORMOSA PLASTICS CORP	3,616	3,686	32,768	123,537	素材	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	12,337	13,838	143,919	542,575	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	株数	当期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	10,650	10,550	12,871	48,523	半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP	4,155	4,235	29,818	112,415	素材	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	500	510	14,101	53,162	食品・生活必需品小売り	
SILICONWARE PRECISION INDS	1,930	1,880	9,155	34,516	半導体・半導体製造装置	
TAIWAN CEMENT	2,907	2,867	9,905	37,344	素材	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	21,230	21,840	453,180	1,708,488	半導体・半導体製造装置	
ASUSTEK COMPUTER INC	617	617	18,099	68,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	387	417	4,253	16,036	半導体・半導体製造装置	
QUANTA COMPUTER INC	2,371	2,331	14,711	55,463	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,123	7,263	35,737	134,729	保険	
ACER INC	2,591	2,591	3,783	14,265	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	8,537	8,964	8,300	31,294	銀行	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	5,545	5,815	22,100	83,318	半導体・半導体製造装置	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,824	2,864	26,065	98,265	素材	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,810	5,950	28,445	107,238	各種金融	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	419	481	3,950	14,894	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDIATEK INC	1,302	1,332	28,445	107,240	半導体・半導体製造装置	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	7,046	7,556	9,634	36,322	銀行	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	13,408	15,589	29,853	112,549	銀行	
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,464	1,424	16,233	61,200	電気通信サービス	
CHINA STEEL CORP	10,329	10,509	25,012	94,297	素材	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	510	510	6,069	22,880	半導体・半導体製造装置	
ADVANTECH CO LTD	268	278	6,679	25,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	802	810	7,334	27,650	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	580	580	18,734	70,627	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AU OPTRONICS CORP	7,630	7,630	8,736	32,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HTC CORP	587	587	4,053	15,281	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	553	603	5,487	20,687	半導体・半導体製造装置	
INVENTEC CORP	1,954	2,204	5,047	19,030	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,320	3,380	35,321	133,160	電気通信サービス	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	231	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PHISON ELECTRONICS CORP	120	140	3,948	14,883	半導体・半導体製造装置	
WPG HOLDINGS LTD	1,274	1,364	5,456	20,569	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	—	550	3,575	13,477	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GIANT MANUFACTURING	240	260	4,771	17,986	耐久消費財・アパレル	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	470	470	2,206	8,319	耐久消費財・アパレル	
SYNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,211	1,271	4,140	15,608	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	8,433	8,273	10,755	40,547	各種金融	
INNOLUX CORP	7,291	7,881	10,206	38,476	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	5,643	6,373	10,931	41,210	銀行	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	6,892	7,012	5,575	21,018	保険	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,400	1,370	10,412	39,253	電気通信サービス	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,434	1,674	10,111	38,121	自動車・自動車部品	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,011	1,011	10,469	39,468	エネルギー	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	9,517	9,647	23,732	89,473	銀行	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	8,045	8,577	16,339	61,601	銀行	
LARGAN PRECISION CO LTD	84	88	43,747	164,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	4,226	4,276	24,588	92,698	食品・飲料・タバコ	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	4,109	4,355	7,622	28,738	銀行	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,012	12,012	9,982	37,633	銀行	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円		
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,852	1,861	9,149	34,494		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP	2,072	2,072	5,948	22,427		素材
YULON MOTOR COMPANY	790	790	2,089	7,877		自動車・自動車部品
POU CHEN	1,965	1,965	8,331	31,410		耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP	2,049	2,090	5,769	21,752		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	650	650	2,626	9,900		素材
INOTERA MEMORIES INC	1,960	—	—	—		半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	1,719	1,699	14,957	56,391		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	2,260	2,260	2,119	7,991		運輸
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	6,310	6,802	12,517	47,189		銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	2,813	2,986	8,735	32,932		保険
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	170	193	3,951	14,895		資本財
EVA AIRWAYS CORP	1,750	1,837	2,728	10,287		運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,533	1,533	2,016	7,600		運輸
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	6,320	6,673	10,410	39,246		銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	220	220	7,711	29,070		小売
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,700	1,700	5,083	19,162		資本財
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	365	—	—	—		半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	760	760	2,793	10,529		不動産
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	650	750	3,817	14,391		不動産
TAIWAN BUSINESS BANK	3,798	3,694	3,085	11,631		銀行
STANDARD FOODS CORP	305	339	2,545	9,598		食品・飲料・タバコ
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	340	340	2,420	9,126		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.	680	680	2,094	7,895		耐久消費財・アパレル
CHAILEASE HOLDING CO LTD	874	944	7,226	27,243		各種金融
TRANSCEND INFORMATION INC	180	180	1,818	6,853		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HERMES MICROVISION INC	32	—	—	—		半導体・半導体製造装置
MERIDA INDUSTRY CO LTD	177	177	2,734	10,309		耐久消費財・アパレル
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	720	790	4,471	16,857		半導体・半導体製造装置
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	164	164	5,280	19,908		耐久消費財・アパレル
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,600	1,990	1,934	7,292		電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	267	299	3,561	13,425		耐久消費財・アパレル
CASETEK HOLDINGS LTD	120	120	972	3,664		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OBI PHARMA INC	90	100	2,630	9,915		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NANYA TECHNOLOGY CORP	—	640	3,212	12,112		半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	130	4,108	15,487		耐久消費財・アパレル
TAIMED BIOLOGICS INC	—	150	2,602	9,811		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	272,506	282,219	1,502,082	5,662,852
	銘柄数	比率	88	88	—	<11.4%>
(インド)			千インドルピー			
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,307	1,335	208,983	371,990		銀行
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	412	421	99,052	176,314		ソフトウェア・サービス
ITC LTD	1,962	3,014	83,386	148,427		食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	662	579	56,738	100,993		家庭用品・パーソナル用品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	532	532	9,275	16,509		資本財
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	752	1,128	20,723	36,888		エネルギー
HINDALCO INDUSTRIES LTD	960	1,078	20,875	37,158		素材
COAL INDIA LTD	612	612	16,789	29,884		エネルギー
GAIL INDIA LTD	338	374	15,281	27,200		公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD	606	526	13,694	24,376		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
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
HERO MOTOCORP LTD	44	44	15,266	27,174	自動車・自動車部品	
BAJAJ AUTO LTD	74	74	22,278	39,655	自動車・自動車部品	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	839	846	54,904	97,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASIAN PAINTS LTD	251	245	28,683	51,055	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	131	131	13,364	23,788	各種金融	
VEDANTA LTD	803	1,313	31,000	55,181	素材	
TATA POWER CO LTD	930	930	7,681	13,673	公益事業	
BHARTI AIRTEL LTD	1,047	861	31,516	56,098	電気通信サービス	
CIPLA LTD	305	305	17,161	30,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NTPC LTD	1,018	1,449	23,234	41,357	公益事業	
INFOSYS LTD	1,563	1,629	153,793	273,753	ソフトウェア・サービス	
ULTRATECH CEMENT LTD	30	77	34,241	60,948	素材	
ACC LTD	38	38	6,419	11,426	素材	
DR. REDDY'S LABORATORIES	103	101	26,199	46,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ICICI BANK LTD	971	952	28,600	50,908	銀行	
LUPIN LTD	193	190	23,934	42,603	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	92	93	63,499	113,029	自動車・自動車部品	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,112	1,151	156,592	278,735	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	1,363	1,443	43,021	76,578	銀行	
TATA STEEL LTD	253	276	12,175	21,672	素材	
LIC HOUSING FINANCE LTD	246	271	18,765	33,402	銀行	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	74	450	32,879	58,525	エネルギー	
IDEA CELLULAR LTD	965	1,075	9,762	17,377	電気通信サービス	
CAIRN INDIA LTD	404	—	—	—	エネルギー	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	102	107	20,549	36,577	家庭用品・パーソナル用品	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	252	—	—	—	各種金融	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	507	507	27,662	49,239	メディア	
POWER FINANCE CORPORATION	215	560	9,049	16,108	各種金融	
DABUR INDIA LTD	470	470	13,088	23,298	家庭用品・パーソナル用品	
JSW STEEL LTD	75	750	14,587	25,965	素材	
LARSEN & TOUBRO LTD	277	283	49,170	87,522	資本財	
UNITED SPIRITS LTD	51	57	12,240	21,788	食品・飲料・タバコ	
TITAN CO LTD	—	273	13,701	24,388	耐久消費財・アパレル	
SIEMENS LTD	61	61	8,650	15,398	資本財	
WIPRO LTD	540	540	27,256	48,515	ソフトウェア・サービス	
AXIS BANK LTD	523	1,485	76,764	136,641	銀行	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	326	331	45,564	81,104	自動車・自動車部品	
TATA MOTORS LTD	724	1,366	58,428	104,002	自動車・自動車部品	
HCL TECHNOLOGIES LTD	493	499	41,884	74,554	ソフトウェア・サービス	
UNITED BREWERIES LTD	56	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DIVI'S LABORATORIES LTD	71	71	4,560	8,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	732	732	26,357	46,916	運輸	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	65	65	8,584	15,280	ヘルスケア機器・サービス	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	760	—	—	—	電気通信サービス	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	8	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	57	71	18,063	32,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	233	257	8,685	15,459	各種金融	
YES BANK LTD	—	298	47,035	83,722	銀行	
NESTLE INDIA LTD	20	20	14,055	25,019	食品・飲料・タバコ	
TECH MAHINDRA LTD	194	397	17,290	30,776	ソフトウェア・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		
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
AUROBINDO PHARMA LTD	232	232	14,485	25,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	267	372	14,985	26,674	自動車・自動車部品	
BOSCH LTD	6	6	15,606	27,778	自動車・自動車部品	
SHREE CEMENT LTD	7	7	14,742	26,241	素材	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	30	37	4,407	7,845	運輸	
MARICO LTD	382	414	12,945	23,043	家庭用品・パーソナル用品	
BHARTI INFRATEL LTD	478	513	19,425	34,577	電気通信サービス	
EICHER MOTORS LTD	10	11	33,889	60,323	資本財	
BHARAT FORGE LTD	93	93	10,570	18,815	自動車・自動車部品	
UPL LTD	248	311	25,684	45,719	素材	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	118	118	10,693	19,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAVELLS INDIA LTD	—	221	11,339	20,184	資本財	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	259	259	27,693	49,294	銀行	
ASHOK LEYLAND LTD	1,012	1,012	8,764	15,601	資本財	
CADILA HEALTHCARE LTD	180	180	8,915	15,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	310	310	8,211	14,617	自動車・自動車部品	
BAJAJ FINANCE LTD	—	141	18,889	33,623	各種金融	
BAJAJ FINSERV LTD	—	34	15,285	27,208	保険	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	—	360	18,970	33,766	エネルギー	
IDFC BANK LTD	—	1,200	7,830	13,937	銀行	
GRASIM INDUSTRIES LTD	—	180	20,831	37,079	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	31,466	38,779	2,287,178	4,071,177	
	銘柄 数 < 比 率 >	73	76	—	< 8.2% >	
(アラブ首長国連邦)				千アラブディルハム		
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,066	3,066	2,296	71,136	不動産	
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,590	2,590	590	18,288	不動産	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,640	1,640	1,200	37,178	銀行	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	584	1,538	1,730	53,595	銀行	
ARABTEC HOLDING CO PJSC	1,904	—	—	—	資本財	
FIRST GULF BANK	761	—	—	—	銀行	
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	1,670	—	—	—	各種金融	
DUBAI ISLAMIC BANK	830	1,037	603	18,700	銀行	
EMAAR MALLS PJSC	1,600	1,600	422	13,081	不動産	
EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,518	1,518	2,718	84,185	電気通信サービス	
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	—	2,600	235	7,279	消費者サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	16,164	15,591	9,798	303,446	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	8	—	< 0.6% >	
(カタール)				千カタールリアル		
MASRAF AL RAYAN	307	307	1,312	41,144	銀行	
OOREDOO QSC	66	66	705	22,118	電気通信サービス	
QATAR NATIONAL BANK	183	201	2,858	89,619	銀行	
INDUSTRIES QATAR	126	126	1,325	41,561	資本財	
VODAFONE QATAR	285	—	—	—	電気通信サービス	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	23	23	476	14,925	公益事業	
QATAR ISLAMIC BANK	49	49	497	15,595	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	83	83	277	8,690	不動産	
COMMERCIAL BANK QSC	134	140	415	13,021	銀行	
DOHA BANK QSC	103	103	329	10,318	銀行	
DOHA BANK QSC - NEW	—	20	65	2,063	銀行	
QATAR INSURANCE CO	105	140	1,000	31,366	保険	

銘柄	株数	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	
(カタル)	百株	百株	千カタルリアル	千円		
QATAR INSURANCE CO-NEW	16	—	—	—	—	保険
EZDAN HOLDING GROUP	666	666	1,058	33,176		不動産
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	234	234	449	14,082		エネルギー
小 計	株 数	2,384	2,163	10,771	337,686	
銘 柄 数 < 比 率 >	14	13	—	<0.7%>		
(南アフリカ)			千南アフリカランド			
BARLOWORLD LTD	180	—	—	—	—	資本財
SAPPI LIMITED	480	480	4,838	41,223		素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	45	49	1,570	13,381		素材
NEDBANK GROUP LTD	173	173	3,821	32,562		銀行
SASOL LTD	472	492	20,106	171,306		素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	355	353	5,330	45,414		素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	534	568	2,497	21,281		素材
GOLD FIELDS LTD	664	728	3,391	28,897		素材
MONDI LTD	104	104	3,596	30,638		素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	865	884	6,242	53,185		小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	392	392	3,076	26,207		小売
TELKOM SA SOC LTD	216	244	1,919	16,354		電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD	143	144	5,675	48,355		食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	1,516	1,243	8,752	74,575		保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD	401	382	7,631	65,016		食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,058	1,146	16,995	144,797		銀行
RMB HOLDINGS LTD	625	625	3,866	32,945		各種金融
REMGRO LTD	420	461	10,372	88,373		各種金融
NETCARE LTD	810	819	2,217	18,888		ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	347	388	104,118	887,085		メディア
MTN GROUP LTD	1,450	1,507	18,204	155,102		電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD	98	98	1,224	10,433		食品・生活必需品小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD	160	134	2,135	18,193		小売
INVESTEC LTD	214	214	2,157	18,381		各種金融
FIRSTSTRAND LTD	2,941	2,979	14,701	125,259		各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	185	185	2,769	23,596		小売
EXXARO RESOURCES LTD	121	161	1,667	14,204		エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	279	279	4,658	39,687		資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	369	364	5,302	45,179		銀行
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	299	323	9,128	77,778		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DISCOVERY LTD	314	314	4,195	35,742		保険
VODACOM GROUP LTD	325	322	4,907	41,814		電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	216	321	2,016	17,183		食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	940	940	2,101	17,907		保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	145	163	2,914	24,834		食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	565	613	2,583	22,013		保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	95	95	1,011	8,616		保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	821	1,178	3,451	29,409		ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD	213	213	3,165	26,966		小売
SIBANYE GOLD LTD	622	673	1,893	16,132		素材
CORONATION FUND MANAGERS LTD	204	204	1,311	11,172		各種金融
BRAIT SE	296	291	2,556	21,783		各種金融
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	295	295	754	6,426		消費者サービス
PSG GROUP LTD	74	84	2,049	17,458		各種金融

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカランド	千円		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	29	36	2,718	23,164	銀行	
PIONEER FOODS GROUP LTD	107	117	1,928	16,430	食品・飲料・タバコ	
FORTRESS INCOME FUND LTD	611	—	—	—	不動産	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	798	—	—	—	不動産	
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	197	206	3,225	27,481	不動産	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	2,523	2,647	18,137	154,529	耐久消費財・アパレル	
BID CORP LTD	—	298	8,883	75,686	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	25,322	24,945	347,777	2,963,064	
	銘柄 数 < 比 率 >	50	48	—	< 6.0% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	6,668,533	6,770,111	—	46,073,633	
	銘柄 数 < 比 率 >	846	825	—	< 92.6% >	

(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	口数	口数	当 期 末		比 率	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(メキシコ)	千口	千口	千メキシコペソ	千円	%	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	213	224	7,515	45,466	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	213	224	7,515	45,466	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.1% >	
(トルコ)			千トルコリラ			
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	167	167	480	15,312	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	167	167	480	15,312	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(南アフリカ)			千南アフリカランド			
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	203	180	4,607	39,253	0.1	
REDEFINE PROPERTIES LTD	389	442	4,918	41,901	0.1	
HYPROP INVESTMENTS LTD	20	22	2,710	23,090	0.0	
RESILIENT REIT LTD	24	25	3,008	25,630	0.1	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	—	79	1,403	11,959	0.0	
FORTRESS INCOME FUND LTD	—	67	2,294	19,546	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	638	818	18,941	161,382	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	6	—	< 0.3% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,019	1,209	—	222,161	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	8	—	< 0.4% >	

(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) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	百万円	百万円
	MINI MS	3,255	—

(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

(2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	46,073,633	91.9
投資証券	222,161	0.4
コール・ローン等、その他	3,832,559	7.7
投資信託財産総額	50,128,353	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(49,734,090千円)の投資信託財産総額(50,128,353千円)に対する比率は99.2%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=113.94円	1 メキシコペソ=6.05円	1 ブラジルレアル=36.28円	100チリペソ=16.95円
100コロンビアペソ=3.89円	1 ユーロ=123.80円	1 トルコリラ=31.86円	1 チェココルナ=4.66円
100ハンガリーフォリント=39.91円	1 ポーランドズロチ=29.30円	1 香港ドル=14.63円	1 マレーシアリングギット=26.22円
1 タイバーツ=3.28円	1 フィリピンペソ=2.28円	100インドネシアルピア=0.86円	100韓国ウォン=10.15円
1 ニュー台湾ドル=3.77円	1 インドルピー=1.78円	1 アラブディルハム=30.97円	1 カタールリアル=31.35円
1 南アフリカランド=8.52円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	50,292,083,314
コール・ローン等	3,253,941,902
株式(評価額)	46,073,633,757
投資証券(評価額)	222,161,469
未収入金	329,406,576
未収配当金	48,521,124
差入委託証拠金	364,418,486
(B) 負債	557,486,697
未払金	163,955,000
未払解約金	393,531,133
未払利息	564
(C) 純資産総額(A-B)	49,734,596,617
元本	21,515,916,530
次期繰越損益金	28,218,680,087
(D) 受益権総口数	21,515,916,530口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,115円

<注記事項>

- ①期首元本額 20,543,703,750円
 期中追加設定元本額 5,589,816,389円
 期中一部解約元本額 4,617,603,609円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.3115円です。

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

eMAXIS 新興国株式インデックス	13,162,396,257円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,224,580,371円
eMAXIS バランス(波乗り型)	188,733,822円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	155,361,770円
コアバランス	98,046円
海外株式セレクション(ラップ向け)	109,786円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	19,612,966円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	4,873,662,643円
新興国株式インデックスオープン	269,021,681円
eMAXIS 全世界株式インデックス	345,562,993円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	136,460,353円
新興国株式インデックスファンド(ラップ向け)	8,253,442円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	2,749,411円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	17,108,374円
eMAXIS 最適化バランス(マイフoward)	21,274,016円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	57,525,928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)	1,434,405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)	1,012,725,407円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	2,412,914円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	13,574,454円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	3,257,491円
合計	21,515,916,530円

○損益の状況 (2016年5月13日~2017年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	930,110,109
受取配当金	920,465,062
受取利息	9,747,678
支払利息	△ 102,631
(B) 有価証券売買損益	10,704,765,762
売買益	12,017,243,005
売買損	△ 1,312,477,243
(C) 先物取引等取引損益	561,166,692
取引益	733,573,237
取引損	△ 172,406,545
(D) 保管費用等	△ 50,753,902
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	12,145,288,661
(F) 前期繰越損益金	15,074,668,766
(G) 追加信託差損益金	5,258,879,978
(H) 解約差損益金	△ 4,260,157,318
(I) 計(E+F+G+H)	28,218,680,087
次期繰越損益金(I)	28,218,680,087

- (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。

アセアン真成長株式マザーファンド

《第7期》決算日2017年12月11日

[計算期間：2017年6月13日～2017年12月11日]

「アセアン真成長株式マザーファンド」は、12月11日に第7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7期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	アセアン諸国の株式等（預託証書（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、主として中長期的な値上がり益の獲得をめざします。株式等への投資にあたっては、事業の安定性・成長性等に着目して銘柄選定を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。運用にあたっては、三菱UFJ国際投信の香港現地法人であるMitsubishi UFJ Investment Services (HK) Limitedから投資助言を受け、三菱UFJ国際投信が運用します。
主要運用対象	アセアン諸国の株式等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		（参考指数）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	騰落中率	MSCI AC ASEAN Index (円換算ベース)	騰落中率			
3期(2015年12月10日)	9,257	△14.9%	79,380.81	△17.8%	95.9%	—	1,209百万円
4期(2016年6月10日)	9,029	△2.5%	75,652.23	△4.7%	96.0%	—	1,127
5期(2016年12月12日)	9,490	5.1%	79,757.44	5.4%	97.1%	—	1,060
6期(2017年6月12日)	10,209	7.6%	84,938.83	6.5%	96.9%	—	779
7期(2017年12月11日)	11,891	16.5%	93,813.53	10.4%	96.1%	—	2,213

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) MSCI AC ASEAN Indexとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、インドネシア、マレーシア、フィリピン、シンガポール、タイの5カ国の株式で構成されています。MSCI AC ASEAN Index (円換算ベース) は、MSCI AC ASEAN Indexをもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI AC ASEAN 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) 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		(参 考 指 数)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	MSCI AC ASEAN Index (円換算ベース)	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017年6月12日	円	%	84,938.83	%	%	%
6月末	10,209	—	86,597.28	—	96.9	—
7月末	10,381	1.7	87,174.29	2.0	95.2	—
8月末	10,498	2.8	87,027.52	2.6	93.9	—
9月末	10,676	4.6	88,712.87	4.4	95.7	—
10月末	11,117	8.9	91,099.46	7.3	94.6	—
11月末	11,630	13.9	92,672.07	9.1	95.5	—
(期 末) 2017年12月11日	11,747	15.1	93,813.53	10.4	96.1	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

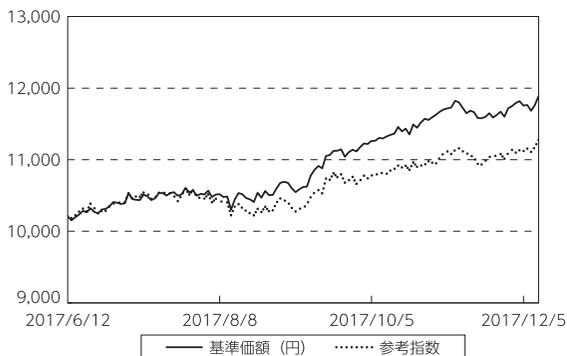
○運用経過

●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16.5%の上昇となりました。

基準価額等の推移



(注) 参考指数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

◎アセアン株式市況

- ・アセアン株式市場は、期を通じて上昇しました。期初には、2017年7月にイエレン米連邦準備制度理事会（FRB）議長が議会証言で金融引き締めを緩やかにを行うことを示唆したことを受けて、投資家のリスク資産に対する投資意欲が回復し、米国株式相場に連動する形で上昇しました。その後も、米国およびアジアでの堅調なマクロ経済指標や企業業績の発表を受けて、堅調な値動きとなりました。
- ・国別では、タイとシンガポールの上昇が大きくなりました。タイは、政情安定化期待やファンダメンタルズの改善が上昇に寄与しました。シンガポールは、景気指標の改善に加えて、業績改善見通しが高まった銀行株の上昇が貢献しました。一方、マレーシアは、全体的に冴えない企業決算発表を受けて下落しました。
- ・アセアンの通貨は、円が米ドルを含む主要通貨に対して下落したため、対円では上昇しました。

- 当該投資信託のポートフォリオについて
 - ・アセアン地域に関しては、人口動態や所得増加を背景に、構造的な個人消費の成長やインフラ投資の増加が期待される中、中長期的な業績成長性を重視した銘柄選定を行いました。また、個別銘柄の組入比率は業績成長の確信度も考慮し決定しました。
 - ・組入銘柄数は、概ね50銘柄程度で推移させました。期中に、業績減速懸念が高まった銘柄を売却し、業績の改善および拡大が期待できる銘柄への入替を実施しました。
 - ・個別に銘柄をみると、インドネシアやタイにおいて内需拡大の恩恵を受けると判断した消費関連銘柄や、構造要因を背景に成長を続けるマレーシアの情報技術関連銘柄に重点的に投資を行いました。特にタイの小売であるCP ALL PCL-NVDRは、安定的な需要拡大を背景に出店による持続的な成長が期待できると判断し、期首より高めの組入比率を維持しました。
 - ・上記投資行動の結果、タイやシンガポールなどの株式市場の上昇およびアセアンの通貨が対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。
 - ・当期の基準価額に影響を与えた主な銘柄は以下の通りです。

(上昇銘柄)

- ・BEAUTY COMMUNITY PCL-NVDR (タイ、小売)：タイを中心に独自ブランドの化粧品やスキンケア商品を直営小売店や提携先で展開しています。直営店舗の出店拡大に加え国内外への卸ビジネスの成長が目覚しく、業績が大きく伸びました。卸ビジネスの拡大に伴う営業利益率の改善が決算で確認されたことから、今後の成長に対する期待感も高まり株価は上昇しました。
- ・V. S. INDUSTRY BERHAD (マレーシア、テクノロジー・ハードウェアおよび機器)：マレーシアにおいて電子機器受託製造サービスに従事しています。成長著しい世界的な家電ブランドからの受注が拡大しています。また、受注拡大に合わせた生産能力の増強計画が明らかにされたこと

から、市場の業績見通しが大きく引き上げられ、株価が大きく上昇しました。

(下落銘柄)

- ・SINGAPORE O&G LTD (シンガポール、ヘルスケア機器・サービス)：シンガポールにおいて産科、婦人科など女性向けのクリニックを展開しています。2016年に流行したジカ熱を背景に出生率が一時的に低下したため業績が悪化し株価は下落しました。しかしながら中長期の成長ストーリーに変化がないことや、今後は回復が想定されることから保有を継続しています。

◎今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国の金融政策や米国長期金利動向は、当地域における投資家資金フローに影響を与えるため、引き続きアセアン株式相場の攪乱要因となる可能性が高いと考えます。しかしながら、アセアン地域の実体経済は、域内の政府主導のインフラ投資、中国をはじめとした世界経済の回復に歩調を合わせ、回復軌道にあります。アセアンの企業業績は、このようなマクロ経済の回復を背景に、着実に増益基調を継続する見込みです。従いまして、中期的には企業業績成長やマクロ経済の改善を反映した堅調な相場展開を想定しています。

◎今後の運用方針

- ・このような見通しを背景に、安定して成長を遂げる企業群に着目したファンド運営を行う方針です。引き続き、消費、インフラ関連銘柄や構造要因を背景に成長を続ける情報技術関連銘柄などを中心とした銘柄選別に注力し、運用方針に即した銘柄への投資を継続します。
- ・独自開発のスクリーニングモデルを活用しつつ、財務分析などの定量調査、企業訪問をはじめとする定性調査を実施し、コンセプトとしている将来にわたって安定して事業が成長すると見込まれる銘柄の選定を行うことで、中長期的な値上がり益の獲得をめざす方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年6月13日～2017年12月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 40 (40)	% 0.368 (0.368)	(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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	9 (9)	0.080 (0.080)	(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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	25 (25) (0)	0.227 (0.226) (0.001)	(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
合 計	74	0.675	
期中の平均基準価額は、11,008円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2017年6月13日～2017年12月11日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	シンガポール	百株 19,879	千シンガポールドル 5,359	百株 6,339	千シンガポールドル 1,369
	マレーシア	13,266 (352)	千マレーシアリングギット 5,593 (—)	3,957	千マレーシアリングギット 1,462
	タイ	56,859	千タイバーツ 114,679	14,231	千タイバーツ 16,773
国	フィリピン	13,179	千フィリピンペソ 89,099	5,716	千フィリピンペソ 19,203
	インドネシア	181,605 (21,620)	千インドネシアルピア 35,395,080 (—)	15,792	千インドネシアルピア 2,821,746

(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。

○株式売買比率

(2017年6月13日～2017年12月11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	1,752,497千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,143,996千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.53

(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

(2017年6月13日～2017年12月11日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
株式	百万円 1,479	百万円 33	2.2	百万円 273	百万円 -	-

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4,363千円
うち利害関係人への支払額 (B)	95千円
(B) / (A)	2.2%

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

○組入資産の明細

(2017年12月11日現在)

外国株式

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	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	381	1,015	1,257	105,599	銀行	
SEMCORP INDUSTRIES LTD	691	—	—	—	資本財	
CAPITALAND LTD	636	1,498	518	43,522	不動産	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	247	670	1,664	139,749	銀行	
KEPPEL CORP LTD	473	1,171	895	75,221	資本財	
VENTURE CORP LTD	160	245	496	41,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	483	—	—	—	資本財	
GENTING SINGAPORE PLC	—	2,656	350	29,439	消費者サービス	
SATS LTD	—	664	349	29,327	運輸	
SHENG SIONG GROUP LTD	1,980	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
SINGAPORE O&G LTD	1,868	4,535	201	16,945	ヘルスケア機器・サービス	
VALUETRONICS HOLDINGS LTD	2,353	5,595	500	42,048	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GUOCOLAND LTD	—	1,716	374	31,412	不動産	
APAC REALTY LTD	—	3,047	263	22,131	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,272 10	22,812 11	6,872 —	577,077 <26.1%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット			
GENTING MALAYSIA BHD	1,237	2,697	1,415	39,376	消費者サービス	
PADINI HOLDINGS BERHAD	1,077	1,276	653	18,168	小売	
GENTING PLANTATIONS BHD	369	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
GLOBETRONICS TECHNOLOGY BHD	772	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MY EG SERVICES BHD	1,959	1,955	398	11,091	ソフトウェア・サービス	
QL RESOURCES BHD	1,110	3,014	1,302	36,215	食品・飲料・タバコ	
ECONPILE HOLDINGS BHD	1,350	3,523	1,092	30,372	資本財	
UZMA BHD	1,849	—	—	—	エネルギー	
SCIENTEX BHD	605	2,102	1,837	51,091	素材	
INARI AMERTRON BHD	1,749	3,593	1,157	32,179	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
V. S. INDUSTRY BERHAD	2,092	4,840	1,461	40,649	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HAI-O ENTERPRISE BHD	970	1,800	954	26,530	小売	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,139 12	24,801 9	10,272 —	285,675 <12.9%>	
(タイ)			千タイバート			
CP ALL PCL-NVDR	1,204	2,334	17,388	60,511	食品・生活必需品小売り	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	304	815	12,306	42,826	銀行	
PTT PCL-NVDR	189	396	16,711	58,154	エネルギー	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	934	2,235	13,968	48,611	運輸	
THAI OIL PCL-NVDR	—	1,434	14,232	49,528	エネルギー	
BANGKOK CHAIN HOSPITAL-NVDR	—	6,225	9,897	34,444	ヘルスケア機器・サービス	
MK RESTAURANTS GROUP - NVDR	412	899	7,281	25,341	消費者サービス	
RS PCL-NVDR	—	2,425	5,989	20,844	メディア	
ROBINSON PCL-NVDR	387	585	4,255	14,810	小売	
BEAUTY COMMUNITY PCL-NVDR	3,310	4,911	9,822	34,180	小売	
CHULARAT HOSPITAL PCL-NVDR	10,457	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PYLON PCL-NVDR	1,789	4,073	6,109	21,261	資本財	
CH. KARNCHANG PUBLIC CO-NVDR	987	—	—	—	資本財	
FORTH SMART SERVICE PCL-NVDR	2,112	5,180	8,961	31,185	ソフトウェア・サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円		
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	843	—	—	—	—	各種金融
TPI POLENE POWER PCL-NVDR	—	18,838	14,976	52,117	—	資本財
PLAN B MEDIA PCL-NVDR	—	12,730	8,274	28,795	—	メディア
MUANGTHAI LEASING PCL-NVDR	—	2,476	9,532	33,173	—	各種金融
小計	株数・金額	22,928	65,556	159,708	555,786	
	銘柄数<比率>	12	15	—	<25.1%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
SM PRIME HOLDINGS INC	—	3,254	11,877	26,723	—	不動産
AYALA LAND INC	3,101	9,557	41,095	92,463	—	不動産
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	792	—	—	—	—	運輸
JOLLIBEE FOODS CORP	179	913	22,730	51,143	—	消費者サービス
BDO UNIBANK INC	—	953	14,104	31,734	—	銀行
D&L INDUSTRIES INC	4,291	—	—	—	—	素材
ROBINSONS RETAIL HOLDINGS IN	603	1,752	16,274	36,618	—	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	8,967	16,430	106,081	238,683	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<10.8%>	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	8,528	11,857	4,908,798	41,233	—	電気通信サービス
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,663	35,672	12,021,464	100,980	—	銀行
UNITED TRACTORS TBK PT	606	1,733	5,701,570	47,893	—	エネルギー
UNILEVER INDONESIA TBK PT	456	1,249	6,357,410	53,402	—	家庭用品・パーソナル用品
PAKUWON JATI TBK PT	31,954	120,322	7,700,608	64,685	—	不動産
NIPPON INDOSARI CORPINDO TBK	11,155	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MITRA ADIPERKASA TBK PT	3,839	9,957	6,521,835	54,783	—	小売
CIPUTRA DEVELOPMENT TBK PT	10,007	22,142	2,634,898	22,133	—	不動産
ACE HARDWARE INDONESIA	—	52,145	6,283,472	52,781	—	小売
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	6,267	7,831	1,918,595	16,116	—	メディア
小計	株数・金額	75,475	262,908	54,048,650	454,008	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<20.5%>	
(ベトナム)			千ベトナムドン			
GEMADEPT CORP	750	750	3,195,000	15,975	—	運輸
小計	株数・金額	750	750	3,195,000	15,975	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.7%>	
合計	株数・金額	132,532	393,257	—	2,127,206	
	銘柄数<比率>	49	50	—	<96.1%>	

(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。

○投資信託財産の構成

(2017年12月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,127,206	% 95.2
コール・ローン等、その他	106,370	4.8
投資信託財産総額	2,233,576	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (2,130,309千円) の投資信託財産総額 (2,233,576千円) に対する比率は95.4%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=113.65円	1 シンガポールドル=83.97円	1 マレーシアリングギット=27.81円	1 タイバーツ=3.48円
1 フィリピンペソ=2.25円	100インドネシアルピア=0.84円	100ベトナムドン=0.50円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年12月11日現在)

○損益の状況 (2017年6月13日～2017年12月11日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,233,576,190
コール・ローン等	105,746,500
株式(評価額)	2,127,206,539
未収配当金	623,151
(B) 負債	19,647,656
未払解約金	19,647,517
未払利息	139
(C) 純資産総額(A-B)	2,213,928,534
元本	1,861,853,068
次期繰越損益金	352,075,466
(D) 受益権総口数	1,861,853,068口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,891円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	8,953,495
受取配当金	8,973,489
受取利息	429
支払利息	△ 20,423
(B) 有価証券売買損益	164,835,296
売買益	198,665,888
売買損	△ 33,830,592
(C) 保管費用等	△ 2,694,795
(D) 当期損益金(A+B+C)	171,093,996
(E) 前期繰越損益金	15,994,783
(F) 追加信託差損益金	173,444,308
(G) 解約差損益金	△ 8,457,621
(H) 計(D+E+F+G)	352,075,466
次期繰越損益金(H)	352,075,466

<注記事項>

- ①期首元本額 763,940,239円
 期中追加設定元本額 1,206,078,111円
 期中一部解約元本額 108,165,282円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,891円です。

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

海外株式セレクション(ラップ向け)	65,531,004円
アセアン真成長株式ファンド	1,753,774,872円
アセアン真成長株式ファンド(ラップ向け)	21,016,954円
アドバンスト・バランスⅠ(FOF s用)(適格機関投資家限定)	4,637,146円
アドバンスト・バランスⅡ(FOF s用)(適格機関投資家限定)	16,893,092円
合計	1,861,853,068円

- (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) (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。
 (注) (G)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。

好配当海外株マザーファンド

《第11期》決算日2017年10月25日

[計算期間：2016年10月26日～2017年10月25日]

「好配当海外株マザーファンド」は、10月25日に第11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11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として、わが国を除く世界主要国の株式等の中から、配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。投資にあたっては、世界を北米、欧州およびアジア・オセアニアの3地域に分け、地域毎の配当利回りの水準、配当成長性の水準および流動性等を勘案し、投資配分を決定します。銘柄選定にあたっては、地域毎に配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄の中から流動性等を勘案して調査対象銘柄を決定し、減配リスク等をチェックし、組入銘柄を選定します。株式の組入比率は高位を基本とします。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	わが国を除く世界主要国の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		(参考指数) MSCI-KOKUSAI インデックス(円換算ベース)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
7期(2013年10月25日)	10,212	47.3	156,821.88	49.7	99.4	—	7,841
8期(2014年10月27日)	11,556	13.2	182,386.54	16.3	98.7	—	7,254
9期(2015年10月26日)	12,187	5.5	208,059.28	14.1	98.9	—	6,657
10期(2016年10月25日)	10,517	△13.7	179,195.86	△13.9	99.0	—	6,203
11期(2017年10月25日)	14,051	33.6	233,139.79	30.1	98.2	—	5,075

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) MSCI-KOKUSAI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インデックス(円換算ベース)は、MSCI KOKUSAIインデックス(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インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 「株式先物比率」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		(参 考 指 数) MSCI-KOKUSAI インデックス(円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2016年10月25日	円 10,517	% —	179,195.86	% —	% 99.0	% —
10月末	10,544	0.3	177,943.65	△ 0.7	98.9	—
11月末	11,444	8.8	194,024.44	8.3	99.0	—
12月末	12,009	14.2	205,852.74	14.9	98.8	—
2017年1月末	12,083	14.9	205,260.43	14.5	98.9	—
2月末	12,177	15.8	209,080.31	16.7	99.0	—
3月末	12,442	18.3	210,645.59	17.6	98.4	—
4月末	12,584	19.7	211,426.63	18.0	97.7	—
5月末	12,851	22.2	213,893.04	19.4	97.4	—
6月末	13,132	24.9	216,771.74	21.0	97.5	—
7月末	13,199	25.5	218,312.80	21.8	98.0	—
8月末	13,219	25.7	217,004.23	21.1	97.1	—
9月末	13,651	29.8	226,693.38	26.5	97.2	—
(期 末) 2017年10月25日	14,051	33.6	233,139.79	30.1	98.2	—

(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33.6%の上昇となりました。

基準価額等の推移



(注) 参考指数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

◎海外株式市況

- ・2016年10月下旬から11月8日の米国大統領選挙にかけては、選挙結果に対する不透明感から下落する局面もありました。しかし、事前の市場予想を裏切ってトランプ大統領の誕生が決定すると減税やインフラ投資などの経済政策の他、金融規制緩和への期待感が高まり、市場は大きく上昇する展開となりました。2017年3月には、欧州諸国において政治に対する不透明感が広まったことから、一時軟調に推移しましたが、4月に実施されたフランスの大統領選挙第1回投票の結果を受けて、同国の政治に対する不透明感が低下したことなどから、株式市場は上昇に転じました。6月になると、欧米の金融政策動向に対して慎重な姿勢が強まり、上値の重い展開となりましたが、米連邦準備制度理事会（FRB）のイエレン議長が6月の利上げ以降も、利上げを急がない姿勢を示唆したことなどを受けて再び上昇基調となりました。8月には、北朝鮮による軍事行動をめぐる不透明感やスペインで発生したテロなどを受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから株価は下落する場面もありましたが、同月の後半には上昇に転じました。その後は、世界景気の拡大が相場の支えとなり、期末にかけて堅調に推移しました。
- ・為替市況は、期首に比べて9.0%の円安・米ドル高、17.9%の円安・ユーロ高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・世界を北米、欧州およびアジア・オセアニアの3地域に分け、地域毎の配当利回りの水準、配当成長性の水準および流動性等を勘案し、地域別配分を決定しています。期末時点においては各地域概ね均等の配分としています。
- ・組入銘柄については地域毎に配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄の中から流動性等を勘案して調査対象銘柄を決定し、減配リスク等をチェックし選定しています。組入銘柄数については配当の水準や成長性

を勘案して投資対象を選別した結果、期首の110銘柄から若干増加し期末は113銘柄となりました。

- ・前記の投資行動に加え、米ドルなど主要通貨が対円で上昇したことなどにより、基準価額は上昇しました。パフォーマンスに寄与・影響した主な銘柄は以下の通りです。

(プラス要因)

◎銘柄

- ・PERSIMMON PLC (英国、耐久消費財・アパレル) : 英国で、住宅などの建設を手掛けています。英国の住宅市場が堅調に推移したことなどを背景に、期を通じて上昇基調で推移しました。
- ・HP INC (米国、テクノロジー・ハードウェアおよび機器) : 米国の大手コンピューターメーカーです。事業環境が良好であったことや、四半期決算が市場予想を上回ったことなどを背景に、株価が上昇しました。

(マイナス要因)

◎銘柄

- ・MACY'S INC (米国、小売) : 主に米国内で展開する大手デパートチェーンです。電子商取引などの拡大によって業績の悪化懸念が広まったことなどを背景に株価は下落しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国ではFRBが2017年3月および6月に政策金利の引き上げを行いました。年内にさらに1回利上げを行うと考えられています。しかし、電子商取引などが急速に普及したことで、モノの価格が透明化されたことなどにより、米国のインフレ率は低い水準にとどまり、その結果、来年以降の利上げのペースは緩慢なものにならざるを得ないとみています。欧州では欧州中央銀行（ECB）の金融緩和政策による下支えは引き続き期待できるものの、スペインのカタ

ルーニャ問題や、難航するイギリスの欧州連合からの離脱交渉などが燻っており、経済の先行きに対する不透明感を払拭するには至っていません。中国においては比較的堅調な経済指標が発表されており、景気の回復が見て取れますが、政策面において今後の方向性が確認できないことから予断を許さない環境が続くとみています。このような環境下、引き続き配当の水準や成長性、持続性を定量面だけではなく定性面からも個別企業調査を実施し、クオリティの高い銘柄群に投資することで将来的な配当収入の最大化や中長期的な値上がり益の獲得を目指します。

◎今後の運用方針

- ・高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。株式の組入比率については運用の基本方針にしたがい、高位（90%以上）を維持する方針です。
- ・地域別配分および銘柄選択に際しては運用の基本方針に則り、配当利回り、配当成長性、流動性等を勘案して決定します。また、個別銘柄選定にあたっては減配リスク等のチェックを行い、配当実現の確度に留意した運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年10月26日～2017年10月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 33 (33)	% 0.261 (0.261)	(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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	7 (7)	0.059 (0.059)	(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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	13 (13) (0)	0.103 (0.102) (0.000)	(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
合 計	53	0.423	
期中の平均基準価額は、12,444円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年10月26日～2017年10月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 2,685	千アメリカドル 13,469	百株 4,525	千アメリカドル 21,982
	カナダ	1,158	千カナダドル 4,570	1,046	千カナダドル 5,763
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	11	143	47	647
	イタリア	804 (280)	357 (-)	3,108	1,252
	フランス	2,066	3,232	2,385	4,073
	オランダ	44	137	169	554
	スペイン	836 (304)	1,470 (10)	2,158 (304)	1,782 (10)
	ベルギー	11	76	49	327
	フィンランド	173	531	394	1,331
	イギリス	4,624 (△ 48)	千イギリスポンド 2,512 (-)	5,967	千イギリスポンド 4,251
	スイス	15 (-)	千スイスフラン 139 (△ 16)	70	千スイスフラン 646
	スウェーデン	205	千スウェーデンクローネ 4,282	274	千スウェーデンクローネ 5,542
	ノルウェー	808 (-)	千ノルウェークローネ 11,418 (△ 405)	969	千ノルウェークローネ 13,687
	デンマーク	19	千デンマーククローネ 499	98	千デンマーククローネ 2,409
	オーストラリア	6,903 (411)	千オーストラリアドル 5,595 (-)	15,681	千オーストラリアドル 10,032
	ニュージーランド	887	千ニュージーランドドル 731	2,636	千ニュージーランドドル 1,448
	香港	4,985 (87)	千香港ドル 11,567 (-)	10,152	千香港ドル 29,995
	シンガポール	4,502	千シンガポールドル 1,868	6,458	千シンガポールドル 2,673

(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。

○株式売買比率

(2016年10月26日～2017年10月25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	10,879,647千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,275,984千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.73

(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

(2016年10月26日～2017年10月25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	$\frac{D}{C}$	%
株式	百万円 4,064	百万円 316	7.8	百万円 6,815	百万円 359	5.3
為替直物取引	3,190	668	20.9	6,109	2,345	38.4

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	16,809千円
うち利害関係人への支払額 (B)	899千円
(B) / (A)	5.3%

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券、三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2017年10月25日現在)

外国株式

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
VERIZON COMMUNICATIONS INC	—	59	290	33,061	電気通信サービス	
CHEVRON CORP	—	27	327	37,338	エネルギー	
CME GROUP INC	57	34	465	53,028	各種金融	
DOMINION ENERGY INC	82	49	401	45,703	公益事業	
DOW CHEMICAL CO/THE	76	—	—	—	素材	
DARDEN RESTAURANTS INC	91	46	380	43,400	消費者サービス	
EXXON MOBIL CORP	—	52	441	50,321	エネルギー	
EXELON CORP	—	84	336	38,352	公益事業	
EATON CORP PLC	130	59	472	53,832	資本財	
NEXTERA ENERGY INC	50	—	—	—	公益事業	
MACY'S INC	112	—	—	—	小売	
GENERAL MILLS INC	—	61	317	36,201	食品・飲料・タバコ	
HP INC	560	219	480	54,784	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KIMBERLY-CLARK CORP	—	30	341	38,877	家庭用品・パーソナル用品	
L BRANDS INC	—	80	356	40,577	小売	
LOCKHEED MARTIN CORP	36	—	—	—	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	97	—	—	—	素材	
ALTRIA GROUP INC	127	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	151	66	455	51,837	保険	
AT&T INC	212	—	—	—	電気通信サービス	
WESTERN DIGITAL CORP	76	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SCANA CORP	58	—	—	—	公益事業	
WEC ENERGY GROUP INC	107	70	469	53,475	公益事業	
WELLS FARGO & CO	156	—	—	—	銀行	
XCEL ENERGY INC	98	74	368	41,971	公益事業	
STAPLES INC	540	—	—	—	小売	
QUALCOMM INC	—	73	397	45,275	半導体・半導体製造装置	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	105	92	486	55,374	半導体・半導体製造装置	
AMEREN CORPORATION	116	78	485	55,287	公益事業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	94	68	503	57,318	公益事業	
REYNOLDS AMERICAN INC	111	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ALLIANT ENERGY CORP	120	82	356	40,661	公益事業	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	—	161	305	34,758	銀行	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	—	43	469	53,443	食品・飲料・タバコ	
CMS ENERGY CORP	142	94	458	52,181	公益事業	
ABBVIE INC	102	54	503	57,376	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	3,606	1,765	9,870	1,124,440	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	24	—	< 22.2% >	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	63	39	398	35,761	銀行	
TRANSCANADA CORP	87	92	560	50,318	エネルギー	
SUN LIFE FINANCIAL INC	239	111	559	50,263	保険	
BCE INC	88	67	395	35,562	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	119	51	506	45,487	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	53	34	387	34,813	銀行	
MANULIFE FINANCIAL CORP	—	197	512	46,053	保険	

銘柄	株数	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		
FORTIS INC	126	95	442	39,784	公益事業	
TORONTO-DOMINION BANK	157	72	517	46,492	銀行	
FIRST CAPITAL REALTY INC	—	201	406	36,536	不動産	
EMERA INC	—	85	413	37,108	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	932	1,044	5,101	458,182	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	11	—	< 9.0% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ALLIANZ SE-REG	38	16	329	44,186	保険	
HANNOVER RUECK SE	52	37	398	53,381	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	90	54	728	97,568	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 1.9% >	
(ユーロ…イタリア)						
SNAM SPA	1,402	—	—	—	エネルギー	
TERNA SPA	1,609	987	503	67,373	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,011	987	503	67,373	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 1.3% >	
(ユーロ…フランス)						
AXA SA	252	—	—	—	保険	
SOCIETE GENERALE SA	—	63	312	41,795	銀行	
BNP PARIBAS	99	70	478	64,034	銀行	
ORANGE	—	277	379	50,762	電気通信サービス	
BOUYGUES SA	122	—	—	—	資本財	
CREDIT AGRICOLE SA	—	316	485	65,005	銀行	
SCOR SE	182	77	272	36,521	保険	
NATIXIS	1,205	736	510	68,320	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,860	1,541	2,437	326,439	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	6	—	< 6.4% >	
(ユーロ…オランダ)						
NN GROUP NV	254	128	465	62,271	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	254	128	465	62,271	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.2% >	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA	—	185	351	47,106	公益事業	
REPSOL SA	—	187	289	38,831	エネルギー	
MAPPRE SA	1,460	—	—	—	保険	
ENAGAS SA	273	170	408	54,741	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	355	223	405	54,310	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,088	766	1,456	194,991	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	< 3.8% >	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	102	63	461	61,796	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	102	63	461	61,796	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.2% >	
(ユーロ…フィンランド)						
UPM-KYMMENE OYJ	257	151	386	51,777	素材	
ELISA OYJ	113	123	431	57,747	電気通信サービス	
ORION OYJ-CLASS B	194	69	268	35,995	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	564	344	1,086	145,519	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 2.9% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	7,970	3,885	7,138	955,961	
	銘柄 数 < 比 率 >	17	18	—	< 18.8% >	

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	株数		期末	
					評価額	評価額
株数・金額	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
BAE SYSTEMS PLC	859	541	324	48,496	資本財	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,575	956	256	38,397	保険	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	130	66	322	48,292	食品・飲料・タバコ	
AVIVA PLC	740	—	—	—	保険	
NATIONAL GRID PLC	371	394	364	54,494	公益事業	
PERSIMMON PLC	173	152	436	65,343	耐久消費財・アパレル	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	128	90	357	53,529	耐久消費財・アパレル	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	450	315	47,157	耐久消費財・アパレル	
TAYLOR WIMPEY PLC	—	1,341	276	41,312	耐久消費財・アパレル	
ADMIRAL GROUP PLC	290	—	—	—	保険	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,303	833	310	46,442	保険	
ROYAL MAIL PLC	650	—	—	—	運輸	
小計	株数・金額	6,219	4,828	2,965	443,466	
	銘柄数<比率>	10	9	—	<8.7%>	
(スイス)			千スイスフラン			
SWISS RE AG	85	42	384	44,242	保険	
SWISS PRIME SITE-REG	48	35	301	34,650	不動産	
小計	株数・金額	133	78	686	78,893	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<1.6%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
SWEDBANK AB - A SHARES	200	173	3,569	49,406	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	250	207	3,804	52,655	資本財	
小計	株数・金額	450	380	7,374	102,062	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<2.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
TELENOR ASA	240	—	—	—	電気通信サービス	
MARINE HARVEST	426	278	4,517	64,232	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	—	226	3,277	46,609	保険	
小計	株数・金額	666	505	7,794	110,841	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<2.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
DANSKE BANK A/S	186	107	2,656	47,781	銀行	
小計	株数・金額	186	107	2,656	47,781	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.9%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	—	170	453	39,940	素材	
ALUMINA LTD	—	1,130	272	24,017	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	146	123	363	32,051	エネルギー	
RIO TINTO LTD	—	54	379	33,480	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	110	73	579	51,122	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	266	175	587	51,790	銀行	
QANTAS AIRWAYS LTD	1,120	—	—	—	運輸	
BORAL LTD	1,266	507	359	31,705	素材	
TELSTRA CORP LTD	1,499	814	289	25,554	電気通信サービス	
AMCOR LIMITED	388	179	284	25,123	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	52	46	434	38,288	各種金融	
CIMIC GROUP LTD	126	98	457	40,305	資本財	
COCA-COLA AMATIL LTD	750	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,486	888	352	31,089	小売	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	—	594	390	34,396	保険	
SONIC HEALTHCARE LTD	247	188	407	35,918	ヘルスケア機器・サービス	
WESFARMERS LTD	82	76	325	28,720	食品・生活必需品小売り	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル	千円	
CHALLENGER LTD	百株 811	百株 467	621	54,794	各種金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	204	—	—	—	エネルギー
TATTS GROUP LTD	—	676	274	24,207	消費者サービス
AUSNET SERVICES	4,899	2,527	444	39,220	公益事業
CROWN RESORTS LTD	464	335	375	33,126	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,500	1,084	405	35,768	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	1,223	948	481	42,460	運輸
HEALTHSCOPE LTD	1,833	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,877	1,826	564	49,752	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	21,356 21	12,989 22	9,106 —	802,836 <15.8%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,152	1,083	399	31,425	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,320	640	406	31,907	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,473 2	1,724 2	805 —	63,332 <1.2%>
(香港)			千香港ドル		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	210	215	2,160	31,546	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	390	240	3,110	45,411	不動産
CLP HOLDINGS LTD	610	410	3,261	47,618	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,085	662	3,378	49,329	不動産
HANG SENG BANK LTD	260	207	3,848	56,182	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	1,370	880	3,317	48,436	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	425	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,950	975	3,714	54,235	銀行
PCCW LTD	4,600	2,700	1,161	16,950	電気通信サービス
KERRY PROPERTIES LTD	—	1,020	3,534	51,600	不動産
NWS HOLDINGS LTD	3,030	2,150	3,306	48,277	資本財
WYNN MACAU LTD	1,816	1,532	3,071	44,846	消費者サービス
CK ASSET HOLDINGS LTD	860	535	3,461	50,537	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	16,606 12	11,526 12	37,327 —	544,974 <10.7%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	908	1,044	281	23,551	メディア
CAPITALAND LTD	2,639	1,467	539	45,104	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD	517	304	665	55,624	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,169	1,031	348	29,115	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,013	766	286	23,935	電気通信サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	534	403	305	25,522	各種金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,176	1,304	264	22,116	運輸
SATS LTD	—	681	318	26,571	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	8,956 7	7,000 8	3,010 —	251,541 <5.0%>
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	70,554 110	45,835 113	— —	4,984,315 <98.2%>

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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。

○投資信託財産の構成

(2017年10月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 4,984,315	% 97.9
コール・ローン等、その他	107,149	2.1
投資信託財産総額	5,091,464	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (5,064,519千円) の投資信託財産総額 (5,091,464千円) に対する比率は99.5%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=113.92円	1 カナダドル=89.81円	1 ユーロ=133.91円	1 イギリスポンド=149.54円
1 スイスフラン=114.92円	1 スウェーデンクローネ=13.84円	1 ノルウェークローネ=14.22円	1 デンマーククローネ=17.99円
1 オーストラリアドル=88.16円	1 ニュージーランドドル=78.58円	1 香港ドル=14.60円	1 シンガポールドル=83.55円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年10月25日現在)

○損益の状況 (2016年10月26日～2017年10月25日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,091,464,959
コール・ローン等	103,181,739
株式(評価額)	4,984,315,273
未収配当金	3,967,947
(B) 負債	16,031,512
未払解約金	16,031,472
未払利息	40
(C) 純資産総額(A-B)	5,075,433,447
元本	3,612,230,104
次期繰越損益金	1,463,203,343
(D) 受益権総口数	3,612,230,104口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,051円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	252,667,159
受取配当金	250,815,589
受取利息	34,333
その他収益金	1,885,691
支払利息	△ 68,454
(B) 有価証券売買損益	1,571,317,970
売買益	1,818,801,610
売買損	△ 247,483,640
(C) 保管費用等	△ 6,596,927
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,817,388,202
(E) 前期繰越損益金	304,991,864
(F) 追加信託差損益金	260,943,850
(G) 解約差損益金	△ 920,120,573
(H) 計(D+E+F+G)	1,463,203,343
次期繰越損益金(H)	1,463,203,343

<注記事項>

- ①期首元本額 5,898,223,015円
期中追加設定元本額 950,042,670円
期中一部解約元本額 3,236,035,581円
また、1口当たり純資産額は、期末14,051円です。

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

海外株式セレクション(ラップ向け)	757,222,790円
三菱UFJ バランスインカム・グローバル(毎月決算型)	1,232,680,172円
好配当海外株ファンド(ラップ向け)	154,283,115円
世界の好配当利回り株ファンド(毎月決算型)	14,441,645円
アドバンスト・バランスⅠ(FOFs用)(適格機関投資家限定)	42,991,863円
アドバンスト・バランスⅡ(FOFs用)(適格機関投資家限定)	228,516,013円
MUAM 好配当海外株ファンド2010-11(適格機関投資家限定)	1,182,094,506円
合計	3,612,230,104円

- (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) (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。
(注) (G) 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。

AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド

《第1期》決算日2017年3月15日

[計算期間：2016年4月13日～2017年3月15日]

「AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド」は、3月15日に第1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1期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として世界各国（除く日本）のインフラ関連企業の株式等に投資を行います。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要なインフラ資産を所有・運営し、その利用料を主な収益源とする企業をいいます。株式等への投資にあたっては、インフラの種類や地域の分散に配慮しながら、個別企業の成長性、配当利回り、割安度、企業のクオリティに着目し、銘柄選定を行います。株式等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。株式等の組入比率は高位を維持することを基本とします。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	世界各国（除く日本）のインフラ関連企業の株式等（預託証券および投資信託証券等を含むことがあります。）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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) 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
	期 騰 落	中 率	(円換算ベース)	期 騰 落				
(設定日)	円	%			%	%	%	百万円
2016年4月13日	10,000	—	180,461	—	—	—	—	497
1期(2017年3月15日)	11,067	10.7	213,417	18.3	88.4	—	9.8	840

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(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 (MSCIコクサイインデックス) (円換算ベース) は、MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス) (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 (MSCIコクサイインデックス) に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(参 考 指 数) 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			
(設定日) 2016年4月13日	10,000	—	180,461	—	—	—	—
4月末	10,145	1.5	186,578	3.4	81.4	—	9.7
5月末	10,117	1.2	187,789	4.1	85.2	—	10.7
6月末	9,661	△ 3.4	169,593	△ 6.0	83.8	—	11.1
7月末	10,076	0.8	180,064	△ 0.2	85.6	—	10.9
8月末	9,905	△ 1.0	179,227	△ 0.7	86.4	—	10.8
9月末	9,928	△ 0.7	174,773	△ 3.2	87.1	—	10.5
10月末	9,826	△ 1.7	177,944	△ 1.4	86.5	—	11.2
11月末	10,113	1.1	194,024	7.5	86.9	—	10.7
12月末	10,773	7.7	205,853	14.1	86.7	—	10.6
2017年1月末	10,590	5.9	205,260	13.7	87.8	—	10.0
2月末	10,841	8.4	209,080	15.9	88.3	—	9.8
(期 末) 2017年3月15日	11,067	10.7	213,417	18.3	88.4	—	9.8

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

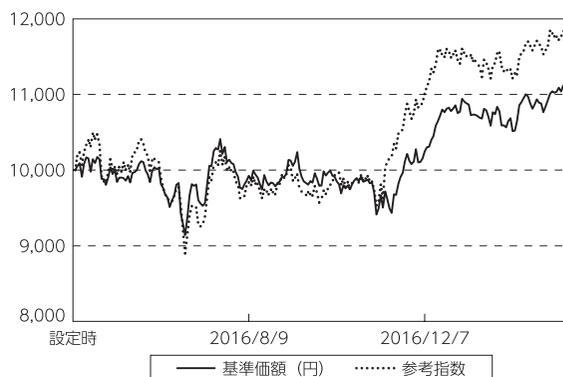
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ10.7%の上昇となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数は設定時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

- ・当期において、グローバル株式市況は上昇しました。
- ・設定時から2016年9月前半までは、英国の欧州連合（EU）離脱などが嫌気されて下落する局面はありましたが、原油価格が堅調に推移する中、米国で追加利上げが見送られたことなどから上昇しました。
- ・その後は、米大統領選挙を巡る不透明感から調整する局面はありましたが、米国の堅調な経済指標などを受けて堅調に推移しました。米大統領選後は、勝利したトランプ氏の打ち出す財政支出拡大や減税策への期待感などから上昇しました。

◎為替市況

- ・英ポンド、ユーロなどが対円で下落した一方、米ドルなどが対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・基準価額は設定時に比べ10.7%の上昇となりました。
- ・北米の石油・ガスの貯蔵・配送セクターや欧州の通信セクターに注目し、幅広い投資を継続しました。組入比率は高位を維持しました。
- ・当期においては、石油・ガスの貯蔵・配送銘柄を中心に、保有するインフラ関連企業の株式が一般的に上昇したことがプラスとなり、基準価額は上昇しました。

- ・設定後、前記の注目セクターに属する企業を中心に株式を買い付け、速やかにポートフォリオの構築を行いました。
- ・ポートフォリオ構築後に新規組入、全株売却した主な銘柄のポイントは以下の通りです。

◎新規組入銘柄

- ・WILLIAMS COS INC（アメリカ、エネルギー）：安定したキャッシュフローが見込めると判断し新規に組み入れました。

◎全株売却銘柄

- ・ENAGAS SA（スペイン、公益事業）：さらなる上値余地が小さいと判断したため全株売却しました。
 - ・以上のような投資行動を行った結果、英ポンドやユーロを除く投資国通貨が概ね対円で上昇したことに加え、保有するインフラ関連企業の株式が上昇したことなどにより、基準価額は上昇となりました。
- パフォーマンスに影響した主な銘柄は以下の通りです。

（プラス要因）

- ・TRANSCANADA CORP（カナダ、エネルギー）：天然ガスや原油市況が上昇したことに加え、安定したキャッシュフロー創出力が注目されたことなどを背景に株価は上昇しました。
- ・VERESEN INC（カナダ、エネルギー）：天然ガスや原油市況が上昇したことに加え、発電事業の売却などが好感され株価は上昇しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・フランスの大統領選の結果や米国のトランプ新政権の具体的な政策などを見極める必要があることからグローバル株式市況は変動幅の大きい展開になると考えています。
- ・一方で、足下の長期金利は上昇しているものの、金融市場では利回りを求める動きが続いており、ディフェンシブ（企業業績が景気動向に左右されにくい）と成長資産の性質を合わせもつインフラ関連銘柄に対する需要は高まると見えています。

◎今後の運用方針

- ・このような投資環境下、持続的にキャッシュフローを創出し、ファンダメンタルズが健全な銘柄に注目します。

- ・そして、それらが本来持つ投資価値からカイ離した際に投資好機が訪れると考え、その機会をうかがっていく方針です。
- ・また、短期的にリスクに対する投資家の志向が変動しやすい環境下においては、長期的なファンダメンタルズおよび持続可能な成長を重視するディフェンシブ・グロース戦略を継続していきます。
- ・セクター別では、モバイルデータ通信量の増加に加え、企業の合併・買収（M&A）の活発化が予想される欧州の通信セクターに注目しています。
- ・また、原油価格の安定化や米国やカナダのエネルギー政策などを背景に北米の石油・ガスの貯蔵・配送セクターについても強気な見方をしています。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年4月13日～2017年3月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 23 (22) (2)	% 0.230 (0.212) (0.018)	(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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	8 (8) (0)	0.081 (0.081) (0.000)	(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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	26 (18) (8)	0.253 (0.176) (0.077)	(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
合 計	57	0.564	
期中の平均基準価額は、10,179円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年4月13日～2017年3月15日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 859	千アメリカドル 2,963	百株 181	千アメリカドル 744
	カナダ	671 (14)	千カナダドル 2,000 (45)	192	千カナダドル 566
	メキシコ	285	千メキシコペソ 2,274	—	千メキシコペソ —
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	イタリア	1,910 (40)	1,095 (△ 5)	151	70
	フランス	286	431	75	130
	スペイン	110	247	70	167
	イギリス	473 (12)	千イギリスポンド 467 (12)	108	千イギリスポンド 142
	スイス	4 (5)	千スイスフラン 177 (△ 2)	5	千スイスフラン 90
	オーストラリア	812	千オーストラリアドル 587	80	千オーストラリアドル 71
香港	2,500	千香港ドル 2,283	100	千香港ドル 105	

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	AMERICAN TOWER CORP	5	591	0.7	72
	CROWN CASTLE INTL CORP	2	248	1	89
	小 計	8	840	1	162

(注) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2016年4月13日～2017年3月15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	1,108,074千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	659,118千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.68

(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

(2016年4月13日～2017年3月15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 532	百万円 532	% 35.3	百万円 759	百万円 -	% -

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

(2017年3月15日現在)

外国株式

銘柄	株数	当 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	千アメリカドル	千円	
EDISON INTERNATIONAL	32	250	28,815	公益事業
P G & E CORP	23	151	17,344	公益事業
SEMPRA ENERGY	33	360	41,364	公益事業
WILLIAMS COS INC	117	328	37,766	エネルギー
GRUPO AEROPORTUARIO CEN-ADR	23	90	10,347	運輸
GRUPO AEROPORTUARIO SUR-ADR	2	35	4,087	運輸
EVERSOURCE ENERGY	27	157	18,084	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15	114	13,092	公益事業
KINDER MORGAN INC	281	591	67,890	エネルギー
CHENIERE ENERGY INC	44	195	22,433	エネルギー
ENBRIDGE ENERGY MANAGEMENT L	57	98	11,258	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	22	70	8,121	エネルギー
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	677 12	2,443 -	280,607 <33.4%>
(カナダ)		千カナダドル		
TRANSCANADA CORP	108	659	56,191	エネルギー
ENBRIDGE INC	137	747	63,735	エネルギー
VERESEN INC	246	336	28,696	エネルギー
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	492 3	1,743 -	148,622 <17.7%>
(メキシコ)		千メキシコペソ		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	285	2,382	13,915	公益事業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	285 1	2,382 -	13,915 <1.7%>
(ユーロ…イタリア)		千ユーロ		
SNAM SPA	202	76	9,385	エネルギー
EI TOWERS SPA	41	216	26,418	電気通信サービス
RAI WAY SPA	537	239	29,157	メディア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	466	214	26,201	電気通信サービス
SIAS SPA	168	142	17,385	運輸
ENAV SPA	382	132	16,107	運輸
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,799 6	1,022 -	124,654 <14.8%>
(ユーロ…フランス)				
EUTELSAT COMMUNICATIONS	32	63	7,802	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	177	153	18,708	運輸
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	210 2	217 -	26,511 <3.2%>
(ユーロ…スペイン)				
CELLNEX TELECOM SAU	40	60	7,389	電気通信サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	40 1	60 -	7,389 <0.9%>
ユ ー ロ 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,050 9	1,300 -	158,554 <18.9%>
(イギリス)		千イギリスポンド		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	115	113	15,902	公益事業

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス) NATIONAL GRID PLC PENNON GROUP PLC	百株 127 134	千イギリスポンド 125 116	千円 17,484 16,293	公益事業 公益事業
小計	株数・金額 376	355	49,681	
	銘柄数<比率>	3	<5.9%>	
(スイス) FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG	5	千スイスフラン 105	12,003	運輸
小計	株数・金額 5	105	12,003	
	銘柄数<比率>	1	<1.4%>	
(オーストラリア) MACQUARIE ATLAS ROADS GROUP APA GROUP	305 426	千オーストラリアドル 144 367	12,551 31,871	運輸 公益事業
小計	株数・金額 732	511	44,423	
	銘柄数<比率>	2	<5.3%>	
(香港) BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,480 920	千香港ドル 1,346 1,012	19,905 14,957	運輸 公益事業
小計	株数・金額 2,400	2,358	34,863	
	銘柄数<比率>	2	<4.1%>	
合計	株数・金額 7,018	—	742,671	
	銘柄数<比率>	33	<88.4%>	

(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	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) AMERICAN TOWER CORP CROWN CASTLE INTL CORP	千口 4 1	千アメリカドル 556 161	千円 63,880 18,530	% 7.6 2.2
合計	口数・金額 6	717	82,410	
	銘柄数<比率>	2	<9.8%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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。

○投資信託財産の構成

(2017年3月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 742,671	% 88.0
投資証券	82,410	9.8
コール・ローン等、その他	19,167	2.2
投資信託財産総額	844,248	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (831,697千円) の投資信託財産総額 (844,248千円) に対する比率は98.5%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=114.83円	1 カナダドル=85.22円	1 メキシコペソ=5.84円	1 ユーロ=121.92円
1 イギリスポンド=139.62円	1 スイスフラン=113.77円	1 オーストラリアドル=86.80円	1 香港ドル=14.78円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年3月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	844,248,860
コール・ローン等	14,252,716
株式(評価額)	742,671,305
投資証券(評価額)	82,410,457
未収入金	3,595,667
未収配当金	1,318,715
(B) 負債	4,118,709
未払金	4,118,699
未払利息	10
(C) 純資産総額(A-B)	840,130,151
元本	759,113,378
次期繰越損益金	81,016,773
(D) 受益権総口数	759,113,378口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,067円

<注記事項>

- ①設定元本額 497,500,000円
 期中追加設定元本額 319,193,702円
 期中一部解約元本額 57,580,324円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,067円です。

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

AMP グローバル・インフラ株式ファンド (ラップ向け)	193,340,165円
AMP グローバル・インフラ株式ファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	565,773,213円
合計	759,113,378円

○損益の状況 (2016年4月13日~2017年3月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	20,646,649
受取配当金	20,628,825
受取利息	98
その他収益金	21,803
支払利息	△ 4,077
(B) 有価証券売買損益	64,754,927
売買益	97,027,324
売買損	△32,272,397
(C) 保管費用等	△ 2,041,425
(D) 当期損益金(A+B+C)	83,360,151
(E) 追加信託差損益金	△ 593,702
(F) 解約差損益金	△ 1,749,676
(G) 計(D+E+F)	81,016,773
次期繰越損益金(G)	81,016,773

- (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) (E)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) (F)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。