

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	無期限（2017年8月16日設定）	
運用方針	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてMSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) に採用されている日本を除く先進国の株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 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為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーフンド	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の株式に直接投資することがあります。
	マザーファンド	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	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。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 ファンドは2018年1月以降、「つみたてNISA（非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

つみたて先進国株式 （為替ヘッジあり）

第1期（決算日：2018年6月25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「つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）」は、去る6月25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）

お客さまのお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			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 分	達 配	み 金	期 騰					中 落	率
(設定日)	円		円		%		%	%	百万円		
2017年8月16日	10,000		—		—	355.11	—	—	1		
1期(2018年6月25日)	10,939		0		9.4	382.34	7.7	89.8	9.2	2.1	27

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(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		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 式 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	(円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率			
(設定日) 2017年8月16日	円 10,000	% —		% —	% —	% —	% —
8月末	9,958	△ 0.4	353.28	△ 0.5	94.3	2.9	2.5
9月末	10,191	1.9	361.01	1.7	92.3	6.5	2.3
10月末	10,435	4.4	369.48	4.0	93.7	3.7	2.3
11月末	10,558	5.6	373.31	5.1	94.0	2.9	2.4
12月末	10,750	7.5	379.43	6.8	95.6	2.5	2.4
2018年1月末	11,114	11.1	392.29	10.5	90.1	5.7	2.1
2月末	10,812	8.1	381.19	7.3	91.4	4.7	2.0
3月末	10,448	4.5	367.77	3.6	92.7	4.4	2.2
4月末	10,646	6.5	373.95	5.3	94.8	4.5	2.2
5月末	10,834	8.3	379.21	6.8	90.2	6.3	2.1
(期 末) 2018年6月25日	10,939	9.4	382.34	7.7	89.8	9.2	2.1

(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) 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。

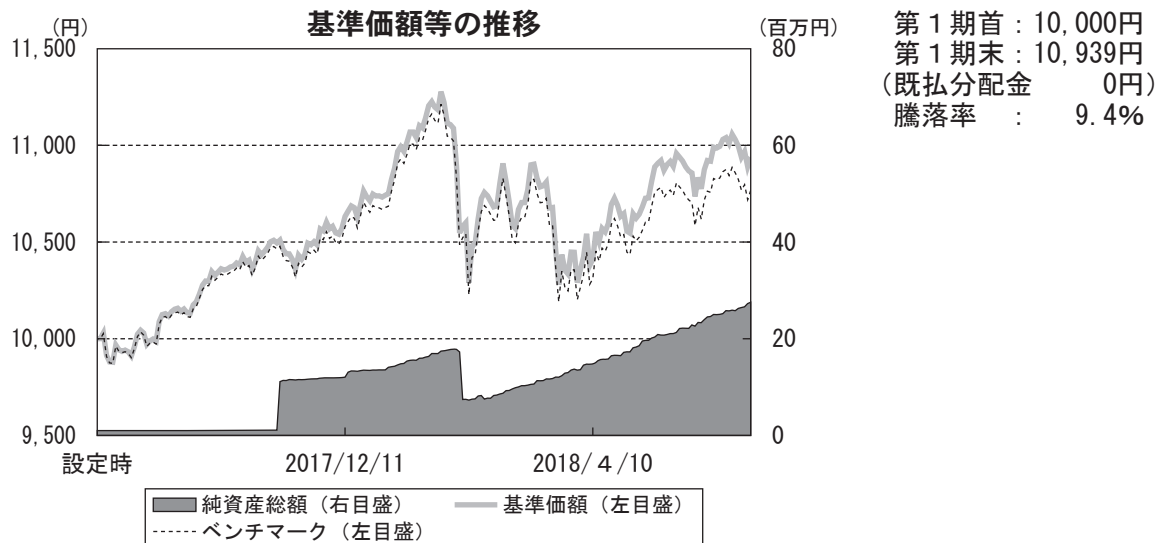
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第1期：2017/8/16～2018/6/25）

基準価額の動き	基準価額は設定時に比べ9.4%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（7.7%）を1.7%上回りました。



・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す。



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	米国の堅調な企業決算内容や税制改革などが好感され外国株式市況が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
------	---

投資環境について

（第1期：2017/8/16～2018/6/25）

◎外国株式市況

- ・米国の堅調な企業決算内容や税制改革などが好感され、外国株式市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

i 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

＜つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）＞

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

＜ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ9.6%の上昇となりました。

- ・ベンチマークであるMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円ヘッジ・円ベース）に採用されている株式（先物・REITを含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。
 - （注）マルチファクターモデル
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル
- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行いました。

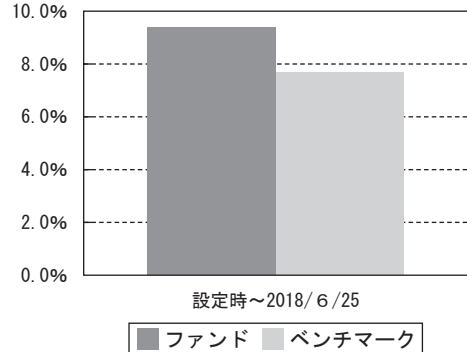
当該投資信託のベンチマークとの差異について

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。

〈つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）〉
ベンチマークとのカイ離は1.7%程度となりました。

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

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



〈ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド〉

ベンチマークは7.7%の上昇となったため、カイ離は1.9%程度となりました。
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ 配当要因※ 1.9%
- ※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

（主なマイナス要因）

- ・ 取引コスト要因

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第1期
	2017年8月16日～2018年6月25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	939

(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。）

<つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）>

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

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド>

- ・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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年8月16日～2018年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	20	0.193	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
（ 投 信 会 社 ）	(9)	(0.087)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(9)	(0.087)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.020)	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	1	0.009	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.004)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.004)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.009	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(1)	(0.009)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	8	0.073	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(7)	(0.068)	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
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	30	0.284	
期中の平均基準価額は、10,574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8月16日～2018年6月25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
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	千口 22,127	千円 37,759	千口 6,399	千円 10,818

○株式売買比率

(2017年8月16日～2018年6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
	ヘッジ付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	38,138,006千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	51,513,026千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.74

(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8月16日～2018年6月25日)

利害関係人との取引状況

<つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）>

該当事項はございません。

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	572,818	333,533	58.2	547,518	326,035	59.5
為替直物取引	3,175	—	—	33,459	9,047	27.0

平均保有割合 0.0%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2017年8月16日～2018年6月25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 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2018年6月25日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド		千口 15,728	千円 27,544

○投資信託財産の構成

(2018年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	千円 27,544	% 99.9
コール・ローン等、その他	17	0.1
投資信託財産総額	27,561	100.0

(注) ヘッジ付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（47,336,247千円）の投資信託財産総額（49,080,080千円）に対する比率は96.4%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=109.69円	1 カナダドル=82.49円	1 ユーロ=127.82円	1 イギリスポンド=145.36円
1 スイスフラン=111.00円	1 スウェーデンクローネ=12.39円	1 ノルウェークローネ=13.53円	1 デンマーククローネ=17.15円
1 オーストラリアドル=81.38円	1 ニュージーランドドル=75.81円	1 香港ドル=13.98円	1 シンガポールドル=80.61円
1 イスラエルシェケル=30.42円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年6月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	27,561,282
コール・ローン等	16,721
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	27,544,561
(B) 負債	13,081
未払信託報酬	12,923
その他未払費用	158
(C) 純資産総額(A-B)	27,548,201
元本	25,183,245
次期繰越損益金	2,364,956
(D) 受益権総口数	25,183,245口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,939円

<注記事項>

- ①設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 35,960,507円
 期中一部解約元本額 11,777,262円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0939円です。

②分配金の計算過程

項 目	2017年8月16日～ 2018年6月25日
費用控除後の配当等収益額	256,927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	346,528円
収益調整金額	1,761,501円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	2,364,956円
1万口当たり収益分配対象額	939円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2017年8月16日～2018年6月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1
支払利息	△ 1
(B) 有価証券売買損益	624,827
売買益	699,662
売買損	△ 74,835
(C) 信託報酬等	△ 21,371
(D) 当期損益金(A+B+C)	603,455
(E) 追加信託差損益金	1,761,501
(売買損益相当額)	(1,761,501)
(F) 計(D+E)	2,364,956
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	2,364,956
追加信託差損益金	1,761,501
(配当等相当額)	(64,257)
(売買損益相当額)	(1,697,244)
分配準備積立金	603,455

- (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に当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<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)
- ②商品性として無手数料とするため、販売手数料に係る記載の削除および記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年5月15日)
- ③2014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。

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2018年5月14日

[計算期間：2017年5月13日～2018年5月14日]

「ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド」は、5月14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	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) 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 (円ヘッジ・円ベース) 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、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。
主要運用対象	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) 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) (円ヘッジ・円ベース)		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	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
7期(2014年5月12日)	12,301	14.8	294.15	12.5	92.9	4.5	2.0	153,665
8期(2015年5月12日)	13,927	13.2	325.42	10.6	95.5	2.4	2.2	91,128
9期(2016年5月12日)	13,282	△ 4.6	303.60	△ 6.7	88.4	10.2	2.5	87,141
10期(2017年5月12日)	15,753	18.6	352.04	16.0	94.3	4.8	2.4	85,648
11期(2018年5月14日)	17,459	10.8	382.52	8.7	92.3	5.1	2.1	47,684

(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円ヘッジ・円ベース) 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) 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) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	(円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率				
(期 首) 2017年5月12日	円	%		%	%	%	%
5月末	15,753	—	352.04	—	94.3	4.8	2.4
6月末	15,826	0.5	353.00	0.3	90.5	6.4	2.3
7月末	15,789	0.2	351.55	△ 0.1	90.5	8.0	2.4
8月末	16,005	1.6	356.19	1.2	91.4	4.3	2.4
9月末	15,916	1.0	353.28	0.4	94.4	2.9	2.5
10月末	16,290	3.4	361.01	2.5	92.4	6.5	2.3
11月末	16,684	5.9	369.48	5.0	93.8	3.7	2.3
12月末	16,883	7.2	373.31	6.0	94.1	2.9	2.4
2018年1月末	17,192	9.1	379.43	7.8	95.6	2.5	2.4
2月末	17,778	12.9	392.29	11.4	90.1	5.7	2.1
3月末	17,297	9.8	381.19	8.3	91.4	4.7	2.0
4月末	16,718	6.1	367.77	4.5	92.8	4.4	2.2
5月末	17,038	8.2	373.95	6.2	94.8	4.5	2.2
(期 末) 2018年5月14日	17,459	10.8	382.52	8.7	92.3	5.1	2.1

(注) 騰落率は期首比。

(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) 「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

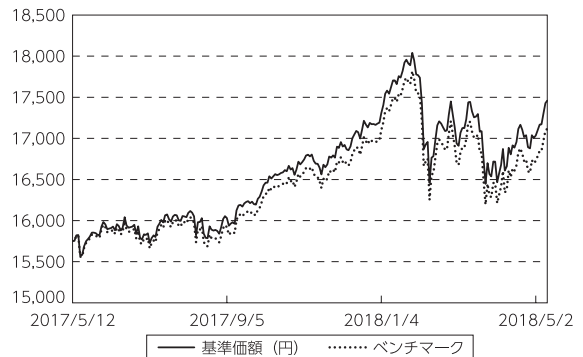
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ10.8%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(8.7%)を2.1%上回りました。

基準価額等の推移



(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内容や税制改革などが好感され、外国株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行いました。

●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8.7%の上昇となったため、カイ離は2.1%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	△0.1%程度	△0.1%程度	2.3%程度	2.1%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・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2.3%程度でした。

その他の要因としては、配当・利子収入、為替ヘッジ効果、売買コスト、保管料等による影響などが含まれます。

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年5月13日～2018年5月14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)	(0.010)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.007	(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)	(1)	(0.007)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.065	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(11)	(0.064)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	14	0.082	
期中の平均基準価額は、16,618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5月13日～2018年5月14日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 3,838 (184)	千アメリカドル 27,986 (Δ 0.51796)	百株 38,385 (252)	千アメリカドル 271,099 (1,857)
	カナダ	593 (Δ 45)	千カナダドル 2,092 (-)	5,094	千カナダドル 20,633
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	348 (34)	2,255 (Δ 72)	2,757	14,378
	イタリア	704 (Δ 1,189)	408 (-)	6,352	2,869
	フランス	441 (7)	1,963 (Δ 15)	3,102	14,387
	オランダ	164	500	2,351	5,748
	スペイン	617 (7,124)	608 (48)	13,918 (800)	4,972 (12)
	ベルギー	26 (16)	156 (-)	226	1,671
	オーストリア	5 (-)	13 (Δ 6)	86	353
	ルクセンブルク	40 (Δ 268)	75 (-)	219	483
	フィンランド	17 (38)	74 (-)	979	1,349
	アイルランド	231 (182)	167 (131)	1,046 (5,478)	715 (131)
	ポルトガル	129	46	418	244
	イギリス	3	12	51	174
	イギリス	5,420 (25,800)	千イギリスポンド 2,792 (Δ 17)	35,852 (40,378)	千イギリスポンド 22,588 (15)
	スイス	273 (463)	千スイスフラン 1,464 (Δ 65)	2,462	千スイスフラン 15,191
	スウェーデン	277 (311)	千スウェーデンクローネ 3,364 (-)	2,990	千スウェーデンクローネ 40,449
	ノルウェー	97 (-)	千ノルウェークローネ 1,291 (Δ 67)	752	千ノルウェークローネ 10,038

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 62	千デンマーククローネ 2,206	百株 684	千デンマーククローネ 20,152
	オーストラリア	865 (△ 1)	千オーストラリアドル 1,304 (-)	8,847 (-)	千オーストラリアドル 13,653 (4)
	ニュージーランド	218	千ニュージーランドドル 162	998	千ニュージーランドドル 476
	香港	1,730 (604)	千香港ドル 4,375 (-)	11,758	千香港ドル 40,476
	シンガポール	882	千シンガポールドル 342	5,115 (381)	千シンガポールドル 2,745 (110)
	イスラエル	5	千イスラエルシケル 180	565	千イスラエルシケル 1,469

(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	—	—	5	151
MACERICH CO/THE	—	—	1	96
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.1	11	0.903	112
PROLOGIS INC	—	—	5	350
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	1	95
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	—	1	44
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	137	2	307
ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	—	0.682	174
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	—	1	121
FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	0.869	109
WELLTOWER INC	0.993	57	4	301
BOSTON PROPERTIES INC	0.356	42	1	228
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	1	134
REALTY INCOME CORP	0.285	16	2	161
REGENCY CENTERS CORP	—	—	1	118
SL GREEN REALTY CORP	0.443	42	1	195
UDR INC	—	—	3	120
VENTAS INC	—	—	4	261
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	—	10	120
WEYERHAEUSER CO	—	—	8	279
AMERICAN TOWER CORP	0.469	65	4	675
AGNC INVESTMENT CORP	0.339	7	2	48
VEREIT INC	6	41	13	104
DUKE REALTY CORP	—	—	4	126
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	0.376	6	2	51
IRON MOUNTAIN INC	—	—	2	110
EQUINIX INC	0.124	49	0.8	359
CROWN CASTLE INTL CORP	1	121	4	452
EQUITY RESIDENTIAL	—	—	4	271
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	0.5	7	4	61
INVITATION HOMES INC	4	105	1	38
JBG SMITH PROPERTIES	—	—	1	55
	(1)	(—)		
GGP INC	0.797	17	6	150
HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	8	160
LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	1	49
PUBLIC STORAGE	0.36	70	1	365
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.317	49	3	641
VORNADO REALTY TRUST	—	—	1	149
KIMCO REALTY CORP	—	—	5	96

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
	AVALONBAY COMMUNITIES INC		0.262	42	1	348
	小 計		18 (1)	892 (-)	140	7,805
	カナダ			千カナダドル		千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		—	—	0.4	12
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		—	—	1	27
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		—	—	1	37
	小 計		—	—	3	77
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
	フランス					
	GECINA SA		—	—	0.47	68
	GECINA SA-RTS		—	—	0.792	2
			(0.792)	(-)		
	KLEPIERRE		—	—	2	97
	UNIBAIL-RODAMCO SE		—	—	1	238
	FONCIERE DES REGIONS		0.219 (-)	18 (△0.82787)	0.556	46
	ICADE		—	—	0.372	27
	小 計		0.219 (0.792)	18 (△0.82787)	6	480
	ユ ー ロ 計		0.219 (0.792)	18 (△0.82787)	6	480
	イギリス			千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC		—	—	12	76	
HAMMERSON PLC		—	—	6	35	
LAND SECURITIES GROUP PLC		—	—	9	92	
		(△0.874)	(△ 8)			
INTU PROPERTIES PLC		—	—	20	44	
SEGRO PLC		7	41	12	66	
小 計		7 (△0.874)	41 (△ 8)	60	314	
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		—	—	46	125	
SCENTRE GROUP		—	—	56	234	
GPT GROUP		—	—	24	127	
MIRVAC GROUP		25	54	53	115	
STOCKLAND		—	—	31	143	
WESTFIELD CORP		—	—	22	189	
DEXUS		—	—	8	84	
GOODMAN GROUP		—	—	21	175	
小 計		25	54	264	1,195	
香港			千香港ドル		千香港ドル	
LINK REIT		—	—	26	1,732	
小 計		—	—	26	1,732	

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	—	—	20	40
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	(—)	(△0.47052)	5	8
	CAPITACOMMERCIAL TRUST-RTS	(—)	(△0.04776)	6	1
	CAPITALAND MALL TRUST	(6)	(—)	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	—	—	23	48
	小計	33	87	51	137
		(—)	(△0.34941)	—	—
		33	87	107	236
		(6)	(△0.86769)		

(注) 金額は受渡金。

(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	百万円	百万円	百万円
		57,857	59,632	—	—

(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

(2017年5月13日～2018年5月14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		51,432,907千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額		57,400,638千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)		0.89

(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5月13日～2018年5月14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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為替先物取引	百万円 772,121	百万円 452,440	% 58.6	百万円 732,030	百万円 435,114	% 59.4
為替直物取引	3,175	—	—	49,273	19,549	39.7

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銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2018年5月14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	
AMERICAN EXPRESS CO	170	79	809	88,434	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	377	188	1,152	125,978	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	71	37	258	28,217	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	11	5	94	10,283	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	98	46	598	65,407	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	14	8	40	4,416	小売
AES CORP	146	57	70	7,723	公益事業
AFLAC INC	89	91	413	45,179	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	225	103	546	59,751	保険
APACHE CORP	83	41	173	19,006	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	173	80	95	10,467	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11	5	109	11,962	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	135	66	1,048	114,664	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	44	25	427	46,751	素材
ANTHEM INC	57	27	633	69,222	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	122	58	400	43,741	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	298	157	471	51,548	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	107	56	398	43,576	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	128	62	2,135	233,440	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	46	30	681	74,527	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	61	33	258	28,278	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	365	174	906	99,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	26	13	744	81,404	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	893	450	2,191	239,563	電気通信サービス
CR BARD INC	16	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	36	35	137	15,043	素材
BAKER HUGHES INC	87	—	—	—	エネルギー
ALLSTATE CORP	80	42	413	45,196	保険
AVERY DENNISON CORP	19	12	131	14,393	素材
CHUBB LTD	101	53	724	79,142	保険
ANALOG DEVICES INC	79	42	394	43,069	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	6	3	224	24,488	小売
CVS HEALTH CORP	233	115	742	81,157	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	208	99	279	30,508	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	784	384	4,372	477,940	銀行
CIGNA CORP	56	26	454	49,697	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	128	67	1,048	114,634	資本財
COCA-COLA CO/THE	897	446	1,882	205,727	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	105	50	466	51,031	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	43	16	68	7,492	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	205	93	591	64,639	運輸
CHEVRON CORP	413	211	2,740	299,581	エネルギー
TAPESTRY INC	61	29	136	14,891	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	35	19	256	28,068	資本財
CONOCOPHILLIPS	271	129	901	98,592	エネルギー
CME GROUP INC	74	38	618	67,593	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CARDINAL HEALTH INC	69	37	207	22,643	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	185	95	597	65,264	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	138	73	476	52,102	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	245	—	—	—	素材
DEVON ENERGY CORP	103	62	253	27,752	エネルギー
DEERE & CO	58	30	443	48,519	資本財
DANAHER CORP	136	71	726	79,393	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	190	—	—	—	素材
WALT DISNEY CO/THE	331	166	1,700	185,891	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	25	12	114	12,559	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	151	80	623	68,156	公益事業
DR HORTON INC	77	39	175	19,172	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	19	—	—	—	小売
TARGET CORP	116	57	401	43,870	小売
DUN & BRADSTREET CORP	7	—	—	—	商業・専門サービス
DAVITA INC	35	16	106	11,674	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	34	16	128	14,037	資本財
DTE ENERGY COMPANY	39	22	227	24,894	公益事業
EXXON MOBIL CORP	909	470	3,823	417,892	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	46	24	342	37,455	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	126	66	776	84,897	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	140	70	507	55,422	資本財
EXELON CORP	202	100	409	44,783	公益事業
ECOLAB INC	57	28	421	46,051	素材
EQUIFAX INC	26	13	151	16,577	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	48	24	345	37,804	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	98	51	390	42,730	資本財
EDISON INTERNATIONAL	71	40	254	27,800	公益事業
ENTERGY CORP	39	19	151	16,540	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	8	3	91	9,956	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	12	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	102	53	863	94,371	公益事業
MACY'S INC	67	42	124	13,636	小売
FEDEX CORP	55	29	731	79,919	運輸
FORD MOTOR CO	812	410	459	50,187	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	81	35	117	12,804	各種金融
FOOT LOCKER INC	29	—	—	—	小売
FIRSTENERGY CORP	94	45	156	17,122	公益事業
FLUOR CORP	30	19	90	9,891	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	284	149	242	26,501	素材
GENERAL MILLS INC	129	67	288	31,490	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	56	29	601	65,712	資本財
WW GRAINGER INC	12	5	177	19,384	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,939	943	1,378	150,629	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	33	16	193	21,097	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	32	16	152	16,701	小売
TEGNA INC	44	—	—	—	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	57	23	60	6,583	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	52	21	62	6,869	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	78	39	958	104,727	各種金融
HALLIBURTON CO	190	92	481	52,661	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	158	78	1,153	126,060	資本財

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
HARLEY-DAVIDSON INC	39	16	67	7,429	自動車・自動車部品
HP INC	374	194	441	48,293	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	82	41	219	23,975	保険
HERSHEY CO/THE	31	15	145	15,877	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	267	129	2,457	268,584	小売
HASBRO INC	24	11	98	10,777	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	56	30	268	29,359	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	198	96	1,394	152,422	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	85	48	261	28,612	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	69	36	525	57,450	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	87	37	90	9,846	メディア
IDEX CORP	—	7	102	11,150	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17	8	106	11,662	素材
JOHNSON & JOHNSON	596	296	3,776	412,793	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	23	10	120	13,214	運輸
KELLOGG CO	577	29	182	19,990	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	78	35	373	40,878	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	338	171	673	73,650	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	197	84	206	22,619	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	38	22	137	15,063	小売
ELI LILLY & CO	217	112	929	101,635	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	22	11	206	22,597	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	34	15	81	8,888	運輸
LENNAR CORP-A	44	30	163	17,892	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	190	88	772	84,397	小売
LEGGETT & PLATT INC	29	19	80	8,760	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	53	26	85	9,368	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	95	43	340	37,215	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	57	27	899	98,292	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	50	25	172	18,867	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	3	73	8,072	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	16	8	163	17,920	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	72	33	469	51,338	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	181	88	1,460	159,653	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	56	27	549	60,073	各種金融
MEDTRONIC PLC	305	147	1,261	137,847	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	604	299	1,790	195,676	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	227	124	646	70,703	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	74	46	69	7,631	耐久消費財・アパレル
3M CO	131	65	1,335	145,948	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33	17	187	20,469	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	102	53	169	18,520	消費者サービス
MASCO CORP	72	34	132	14,473	資本財
MONSANTO CO	95	50	625	68,384	素材
M & T BANK CORP	30	13	243	26,582	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	112	53	439	48,014	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	7	150	16,435	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	308	146	807	88,251	各種金融
MCKESSON CORP	49	24	365	39,992	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	204	98	462	50,546	保険
MANPOWERGROUP INC	15	6	59	6,474	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	38	17	302	33,104	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NORFOLK SOUTHERN CORP	63	29	451	49,393	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,215	1,095	3,388	370,426	銀行
NISOURCE INC	72	47	118	12,968	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	36	18	616	67,418	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	107	68	79	8,713	銀行
NEWMONT MINING CORP	116	70	283	31,002	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	232	109	413	45,229	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25	13	139	15,242	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	3	1	184	20,126	保険
NUCOR CORP	69	37	237	25,997	素材
NEWELL BRANDS INC	94	53	146	15,966	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	94	49	185	20,263	メディア
NOBLE ENERGY INC	94	51	177	19,433	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	167	82	703	76,951	エネルギー
OMNICOM GROUP	51	26	195	21,395	メディア
PEPSICO INC	314	155	1,519	166,098	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	20	9	113	12,416	素材
ALTRIA GROUP INC	427	207	1,144	125,132	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	24	16	126	13,782	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	560	280	2,060	225,235	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	106	54	824	90,103	銀行
PFIZER INC	1,329	658	2,337	255,535	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	94	44	445	48,726	保険
PULTEGROUP INC	64	19	62	6,799	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	29	12	223	24,444	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	37	18	369	40,419	エネルギー
CITIGROUP INC	624	292	2,133	233,219	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	62	34	205	22,513	保険
PPG INDUSTRIES INC	57	28	289	31,616	素材
PENTAIR PLC	37	18	81	8,901	資本財
PRAXAIR INC	62	29	472	51,605	素材
P G & E CORP	112	55	241	26,399	公益事業
PPL CORP	149	84	236	25,799	公益事業
PROGRESSIVE CORP	127	67	422	46,159	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	111	55	282	30,829	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	37	20	214	23,487	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	64	33	709	77,600	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	52	26	178	19,471	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	269	142	276	30,182	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	9	5	69	7,569	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	22	11	309	33,812	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	91	44	117	12,870	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	28	10	69	7,579	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	12	216	23,706	資本財
SCHLUMBERGER LTD	304	157	1,117	122,132	エネルギー
STRYKER CORP	73	35	607	66,415	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	262	137	818	89,518	各種金融
SEMPRA ENERGY	52	26	283	31,041	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17	9	376	41,115	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	32	18	269	29,483	資本財
SUNTRUST BANKS INC	107	52	364	39,803	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	62	32	422	46,154	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	
SOUTHERN CO/THE	216	110	497	54,417	公益事業
AT&T INC	1,346	678	2,190	239,389	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	62	35	276	30,173	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	84	43	439	48,093	各種金融
SYSCO CORP	114	57	360	39,436	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	41	13	59	6,513	素材
SCANA CORP	30	12	43	4,794	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	218	107	1,173	128,270	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	27	13	137	15,083	小売
TORCHMARK CORP	24	10	93	10,236	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	206	107	390	42,718	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	86	45	989	108,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	59	28	189	20,718	資本財
UNION PACIFIC CORP	180	86	1,238	135,352	運輸
UNUM GROUP	51	24	92	10,142	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	171	81	1,016	111,059	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	208	107	2,554	279,269	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	372	177	915	100,120	銀行
MARATHON OIL CORP	185	90	189	20,726	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	151	78	907	99,166	運輸
VALERO ENERGY CORP	99	47	540	59,067	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	20	9	109	11,942	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	16	—	—	—	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	86	41	219	23,968	メディア
VF CORP	72	36	280	30,704	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	29	14	186	20,410	素材
WILLIAMS COS INC	178	87	238	26,080	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	201	92	595	65,061	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	69	30	186	20,397	公益事業
WALMART INC	338	162	1,354	148,015	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	1,045	517	2,816	307,923	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	96	44	366	40,077	商業・専門サービス
WATERS CORP	17	8	171	18,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	203	—	—	—	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	16	7	119	13,093	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	189	32	97	10,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	112	54	248	27,200	公益事業
KEYCORP	236	102	208	22,755	銀行
CARMAX INC	42	20	131	14,338	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	43	24	279	30,585	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	34	14	60	6,645	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	76	35	304	33,271	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	142	65	552	60,422	小売
CA INC	68	31	112	12,343	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	28	15	182	19,922	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	31	14	157	17,220	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	62	29	124	13,601	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	76	41	265	28,978	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	68	36	381	41,745	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	91	44	168	18,456	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	67	30	234	25,665	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	164	70	240	26,308	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STERICYCLE INC	18	12	77	8,483	商業・専門サービス
INTEL CORP	1,038	516	2,824	308,695	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,098	546	2,512	274,612	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	18	10	185	20,304	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	27	13	218	23,835	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	95	46	913	99,888	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	236	122	669	73,169	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	65	33	448	49,039	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	63	31	213	23,328	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	137	71	139	15,275	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	86	43	352	38,532	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	47	28	269	29,444	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	292	149	1,024	112,029	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	163	73	1,274	139,366	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	38	20	199	21,809	銀行
NORTHERN TRUST CORP	47	24	271	29,705	各種金融
MICROSOFT CORP	1,619	810	7,914	865,185	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	19	9	157	17,197	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	37	20	239	26,232	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	142	—	—	—	小売
STARBUCKS CORP	318	153	881	96,325	消費者サービス
ORACLE CORP	674	340	1,595	174,422	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	69	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	93	47	1,546	169,077	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	20	8	228	24,933	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	129	75	543	59,455	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41	20	196	21,515	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	17	16	120	13,179	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	29	12	87	9,558	小売
LAM RESEARCH CORP	35	18	376	41,198	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	17	11	217	23,739	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,044	514	1,640	179,314	メディア
XILINX INC	55	28	200	21,898	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	76	33	213	23,380	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	50	26	125	13,681	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	16	8	250	27,433	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	288	139	923	100,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	34	16	175	19,183	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	8	12	577	63,123	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	53	28	546	59,693	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	—	5	173	19,019	銀行
NUANCE COMMUNICATIONS INC	60	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	70	37	240	26,289	ソフトウェア・サービス
ALTA BA INC	199	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	18	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	11	7	98	10,808	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	28	14	146	15,985	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	6	88	9,647	運輸
AUTODESK INC	43	23	315	34,527	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	54	19	57	6,240	メディア
SALESFORCE.COM INC	141	78	1,022	111,734	ソフトウェア・サービス

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
NORDSTROM INC	28	17	85	9,329	小売
ALPHABET INC-CL A	64	32	3,635	397,411	ソフトウェア・サービス
EAST WEST BANCORP INC	—	13	97	10,622	銀行
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	6	7,108	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	26	16	99	10,868	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	54	25	89	9,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	323	156	865	94,626	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	55	30	115	12,584	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	32	16	147	16,167	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	62	30	172	18,901	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	88	45	7,248	792,318	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	53	28	339	37,075	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	30	15	154	16,907	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	34	17	197	21,550	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	—	30	147	16,132	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	59	30	193	21,171	各種金融
CERNER CORP	66	27	165	18,052	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	88	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	33	14	69	7,582	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	20	9	114	12,567	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	66	—	—	—	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC	39	31	239	26,139	商業・専門サービス
EBAY INC	232	102	393	43,034	ソフトウェア・サービス
IAC/INTERACTIVECORP	—	7	106	11,652	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	118	66	1,681	183,768	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	51	28	267	29,198	小売
BOOKING HOLDINGS INC	10	5	1,100	120,265	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	268	140	2,796	305,672	各種金融
BB&T CORP	178	82	454	49,641	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	231	117	673	73,629	各種金融
BORGWARNER INC	47	21	108	11,849	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	48	28	78	8,630	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	25	11	132	14,442	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	169	88	829	90,699	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	36	18	163	17,892	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	12	7	66	7,217	保険
AETNA INC	76	34	600	65,642	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	53	26	151	16,560	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	108	57	385	42,116	公益事業
AON PLC	57	26	375	41,014	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	125	54	239	26,181	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	18	12	71	7,806	保険
HESS CORP	62	31	196	21,479	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	75	37	100	11,004	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	57	26	161	17,680	各種金融
RED HAT INC	39	20	355	38,874	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	14	5	92	10,119	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	49	22	70	7,758	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	38	14	112	12,318	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	60	29	216	23,644	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	37	20	137	15,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	95	39	82	9,027	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BIOGEN INC	47	24	682	74,608	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	32	16	451	49,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	109	53	1,305	142,669	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	54	29	462	50,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	200	108	209	22,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	33	—	—	—	小売
CELGENE CORP	169	89	754	82,476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	132	68	528	57,717	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	135	63	460	50,285	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	39	18	133	14,591	運輸
FASTENAL CO	63	32	170	18,598	資本財
FISERV INC	47	46	335	36,728	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	120	51	76	8,394	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	380	156	106	11,591	メディア
APPLE INC	1,168	566	10,689	1,168,507	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34	16	117	12,838	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	237	116	176	19,260	銀行
ZIONS BANCORPORATION	—	16	93	10,199	銀行
COSTAR GROUP INC	7	3	139	15,216	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	49	24	291	31,836	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	31	14	126	13,776	運輸
CENTURYLINK INC	119	108	212	23,226	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	29	19	107	11,803	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	99	52	201	22,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	46	46	307	33,563	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	187	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY	64	30	173	19,006	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	30	14	103	11,365	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	16	6	80	8,823	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	82	39	159	17,418	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	38	19	438	47,881	食品・飲料・タバコ
NVR INC	—	0.38	116	12,684	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	43	31	87	9,556	エネルギー
COOPER COS INC/THE	10	5	117	12,832	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	37	26	134	14,654	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	67	33	296	32,361	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	21	6	49	5,405	保険
AGCO CORP	14	8	54	5,971	資本財
DISCOVERY INC - A	34	23	57	6,301	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	87	43	213	23,363	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	27	13	156	17,095	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	51	23	92	10,099	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	132	64	186	20,440	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	34	16	222	24,302	各種金融
ANDEAVOR	26	18	255	27,945	エネルギー
FNF GROUP	53	26	102	11,177	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	130	60	430	47,106	各種金融
NASDAQ INC	25	11	102	11,183	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40	22	43	4,704	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	—	20	89	9,737	メディア
VIACOM INC-CLASS B	76	36	111	12,199	メディア
AUTOLIV INC	19	8	124	13,582	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CBRE GROUP INC - A	66	32	155	16,952	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	2	99	10,914	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	46	27	154	16,918	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC QVC GROUP	93	58	128	13,994	小売
ARROW ELECTRONICS INC	20	4	37	4,077	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	35	17	257	28,152	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	26	15	98	10,746	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	71	30	75	8,247	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13	6	143	15,637	素材
RANGE RESOURCES CORP	39	33	47	5,156	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	108	—	—	—	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	20	9	96	10,534	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	12	7	78	8,615	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	50	22	95	10,432	公益事業
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	23	8	91	9,951	消費者サービス
HANESBRANDS INC	82	34	57	6,261	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	211	104	2,014	220,185	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	106	44	87	9,572	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	—	18	120	13,133	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	33	12	67	7,357	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	—	11	98	10,814	資本財
AVNET INC	27	14	60	6,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPG PHOTONICS CORP	—	3	96	10,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	72	31	83	9,177	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	40	26	81	8,950	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	11	5	193	21,128	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	26	11	140	15,376	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	28	15	243	26,647	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	66	48	90	9,924	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	77	39	371	40,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	86	41	310	33,926	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	24	8	81	8,875	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	11	4	60	6,587	資本財
MERCADOLIBRE INC	9	4	137	15,064	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	14	7	103	11,273	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	62	30	157	17,221	保険
SEATTLE GENETICS INC	22	14	80	8,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	12	6	158	17,325	小売
LKQ CORP	67	32	98	10,747	小売
HORMEL FOODS CORP	63	28	103	11,304	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	17	11	41	4,549	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	32	15	165	18,141	素材
HARRIS CORP	27	13	214	23,441	資本財
HUMANA INC	32	16	472	51,663	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	36	—	—	—	エネルギー
INVESCO LTD	89	46	130	14,284	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	37	18	166	18,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	30	17	114	12,568	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	36	17	156	17,095	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	31	18	278	30,478	エネルギー
MSCI INC	19	9	149	16,346	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	20	13	89	9,824	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	
MOLSON COORS BREWING CO -B	41	20	126	13,785	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	339	169	1,375	150,385	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	409	200	2,648	289,452	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	39	20	245	26,799	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	9	—	—	—	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	102	48	109	11,924	エネルギー
FLOWSERVE CORP	28	19	82	9,059	資本財
HELMERICH & PAYNE	23	15	104	11,394	エネルギー
T-MOBILE US INC	63	35	197	21,629	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	17	—	—	—	メディア
DISCOVERY INC-C	48	39	90	9,926	メディア
RESMED INC	30	14	150	16,477	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	18	9	129	14,111	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	50	25	187	20,517	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26	13	111	12,180	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	56	25	122	13,337	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	19	8	108	11,827	運輸
PERRIGO CO PLC	31	13	102	11,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	29	14	127	13,964	素材
WABTEC CORP	19	7	68	7,507	資本財
EVERSOURCE ENERGY	70	39	228	24,958	公益事業
INGREDION INC	16	7	82	9,064	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	82	34	536	58,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	30	12	55	6,109	素材
CALPINE CORP	74	—	—	—	公益事業
EATON VANCE CORP	24	16	92	10,092	各種金融
DELTA AIR LINES INC	41	18	97	10,668	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	40	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	39	20	169	18,551	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	34	18	193	21,145	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	61	29	279	30,506	小売
FORTINET INC	31	20	124	13,576	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	10	69	7,636	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5	2	163	17,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	44	17	92	10,082	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	253	—	—	—	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	301	135	500	54,740	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	65	34	344	37,630	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	75	39	447	48,900	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	10	4	101	11,046	資本財
HCA HEALTHCARE INC	65	28	285	31,196	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	36	15	106	11,612	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	115	50	391	42,839	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	23	10	90	9,936	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	33	15	84	9,281	資本財
DEXCOM INC	19	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	12	5	58	6,358	資本財
XYLEM INC	39	18	136	14,949	資本財
TRIPADVISOR INC	26	15	75	8,300	小売
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	5	92	10,154	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	33	16	159	17,411	銀行
ALLEGHANY CORP	3	1	87	9,540	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	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16	8	259	28,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	103	47	560	61,285	エネルギー
FACEBOOK INC-A	513	263	4,926	538,508	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	62	32	147	16,106	公益事業
ALBEMARLE CORP	24	12	124	13,625	素材
PVH CORP	17	7	121	13,329	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	416	232	384	41,993	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	78	39	118	12,993	商業・専門サービス
APTIV PLC	59	28	273	29,912	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	37	16	87	9,533	資本財
SPLUNK INC	29	14	170	18,685	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	44	27	92	10,143	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	13	5	56	6,153	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	356	175	1,831	200,188	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	28	14	440	48,145	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	44	20	130	14,280	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	27	13	122	13,426	各種金融
ZOETIS INC	103	56	473	51,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	23	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	82	52	79	8,733	メディア
SPRINT CORP	174	111	57	6,280	電気通信サービス
SNAP-ON INC	12	5	86	9,461	資本財
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	35	14	94	10,294	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	124	70	230	25,209	ソフトウェア・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	10	132	14,488	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	35	32	261	28,550	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	26	14	199	21,826	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	36	20	365	40,003	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	19	8	103	11,268	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	20	10	210	22,985	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	—	8	68	7,518	資本財
ALPHABET INC-CL C	68	34	3,816	417,176	ソフトウェア・サービス
NAVIENT CORP	65	—	—	—	各種金融
UNITED RENTALS INC	18	9	156	17,056	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	29	11	46	5,131	運輸
VOYA FINANCIAL INC	42	16	89	9,769	各種金融
ANTERO RESOURCES CORP	34	15	28	3,161	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	32	15	162	17,736	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	92	48	128	13,995	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	43	32	272	29,740	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	28	12	80	8,809	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	19	9	111	12,181	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	24	14	105	11,478	メディア
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	11	129	14,136	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	—	10	73	7,995	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	34	17	91	9,967	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	20	10	208	22,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD	13	—	—	—	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	180	91	310	33,974	各種金融
QORVO INC	28	12	100	10,940	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	38	18	126	13,863	保険
ACUIITY BRANDS INC	9	3	45	4,949	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	
JONES LANG LASALLE INC	9	6	110	12,040	不動産
ARAMARK	50	17	65	7,156	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	111	57	244	26,686	銀行
LEAR CORP	15	6	135	14,855	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	9	94	10,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	47	32	102	11,177	素材
RITE AID CORP	230	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP	40	21	103	11,340	エネルギー
CHEMOURS CO/THE	—	17	90	9,943	素材
LIBERTY LATIN AMERIC-CL C	24	—	—	—	メディア
WESTROCK CO	55	27	164	18,032	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	133	66	394	43,081	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	237	123	974	106,546	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	24	16	90	9,855	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	366	162	286	31,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	39	—	—	—	自動車・自動車部品
AMERCO	1	0.88	30	3,297	運輸
CDW CORP/DE	32	16	127	13,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC	20	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP	46	28	66	7,214	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	71	41	80	8,785	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	—	6	165	18,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	—	17	86	9,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	—	14	104	11,387	商業・専門サービス
WR GRACE & CO	15	9	66	7,219	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	41	30	51	5,595	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	43	13	59	6,453	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20	14	62	6,839	メディア
LIBERTY MEDIA COR-LIBERTY-C	—	17	52	5,711	メディア
VAIL RESORTS INC	—	3	93	10,225	消費者サービス
DOMINO'S PIZZA INC	11	4	120	13,167	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	47	19	539	59,015	メディア
IDEXX LABORATORIES INC	20	9	194	21,280	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	32	13	88	9,652	資本財
UGI CORP	39	16	81	8,907	公益事業
WESTAR ENERGY INC	32	13	70	7,749	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	20	80	8,797	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	68	30	230	25,244	資本財
IHS MARKIT LTD	78	47	249	27,295	商業・専門サービス
XL GROUP LTD	58	32	181	19,796	保険
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	24	120	13,146	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	49	23	176	19,253	ソフトウェア・サービス
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	13	—	—	—	素材
COTY INC-CL A	106	49	70	7,760	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC	96	41	74	8,165	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	48	31	98	10,735	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	14	6	97	10,692	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	6	4	29	3,273	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC	10	4	125	13,678	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	34	26	89	9,742	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE CORP	25	15	66	7,262	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	98	45	144	15,843	エネルギー

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		
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	15	120	13,217		ヘルスケア機器・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	10	114	12,528		各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	62	31	325	35,559		ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	14	69	7,585		保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	10	119	13,032		保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	17	51	5,601		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	18	74	8,090		資本財
ROLLINS INC	—	13	66	7,288		商業・専門サービス
TESARO INC	—	5	25	2,789		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAKER HUGHES A GE CO	—	44	158	17,379		エネルギー
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	11	57	6,268		保険
DOWDUPONT INC	—	256	1,718	187,885		素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	17	71	7,829		運輸
SQUARE INC - A	—	26	143	15,674		ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	—	37	85	9,330		公益事業
BROADCOM INC	—	46	1,128	123,388		半導体・半導体製造装置
APERGY CORP	—	8	31	3,460		エネルギー
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	260	110	79	8,669		不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	50	22	81	8,878		資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	55	25	152	16,642		資本財
小計	株数・金額	68,340	33,726	263,331	28,784,806	
	銘柄数<比率>	596	601	—	<60.4%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	325	158	1,586	135,682		銀行
IMPERIAL OIL LTD	66	29	120	10,276		エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	71	30	144	12,355		各種金融
TRANSCANADA CORP	190	103	576	49,309		エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	79	44	270	23,149		電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	134	59	321	27,478		保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	124	62	220	18,861		素材
BARRICK GOLD CORP	255	127	218	18,720		素材
BCE INC	32	13	69	5,981		電気通信サービス
AGRIUM INC	29	—	—	—		素材
BOMBARDIER INC-B	427	274	113	9,704		資本財
BANK OF MONTREAL	141	67	675	57,759		銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	196	90	466	39,929		各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	265	136	1,088	93,101		銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	72	31	82	7,065		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	56	35	85	7,299		資本財
CAMECO CORP	89	52	76	6,552		エネルギー
CI FINANCIAL CORP	53	20	50	4,359		各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	87	48	552	47,264		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	242	130	598	51,203		エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	168	85	863	73,866		運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	15	6	97	8,339		小売
ENBRIDGE INC	356	188	811	69,383		エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5	3	213	18,278		保険
CGI GROUP INC - CLASS A	47	22	169	14,514		ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	77	25	46	4,005		エネルギー
IGM FINANCIAL INC	21	11	42	3,670		各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	49	24	157	13,512		食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	432	216	536	45,864		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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
MAGNA INTERNATIONAL INC	83	42	339	29,028	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	74	40	253	21,678	銀行
ONEX CORPORATION	18	11	100	8,577	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	184	—	—	—	素材
POWER CORP OF CANADA	82	33	98	8,415	保険
POWER FINANCIAL CORP	55	21	67	5,779	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	91	41	107	9,182	メディア
SUNCOR ENERGY INC	365	190	967	82,767	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	11	7	72	6,242	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	31	16	381	32,640	運輸
ENCANA CORP	216	104	175	15,036	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	49	23	131	11,243	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	38	27	89	7,687	資本財
GOLDCORP INC	187	87	153	13,136	素材
KINROSS GOLD CORP	265	176	83	7,182	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	33	23	129	11,036	資本財
GREAT-WEST LIFECO INC	65	28	93	7,998	保険
METHANEX CORP	20	12	106	9,118	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	222	161	60	5,165	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	16	10	24	2,094	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	48	12	44	3,772	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	56	30	128	10,976	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	111	42	62	5,328	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	41	28	127	10,946	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	151	70	145	12,474	素材
YAMANA GOLD INC	222	—	—	—	素材
FORTIS INC	89	48	202	17,333	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	92	49	262	22,468	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	152	—	—	—	素材
LUNDIN MINING CORP	—	96	82	7,021	素材
TORONTO-DOMINION BANK	407	199	1,485	127,121	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	39	21	197	16,858	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	96	42	117	10,049	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	34	29	71	6,108	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	22	15	78	6,681	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	17	53	4,619	公益事業
METRO INC	50	31	126	10,852	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	58	25	111	9,521	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	29	14	133	11,432	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	118	32	33	2,866	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	223	109	152	13,045	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	78	46	61	5,245	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	50	30	70	6,008	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	87	60	268	22,960	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	26	16	70	6,036	エネルギー
DOLLARAMA INC	24	11	161	13,832	小売
KEYERA CORP	41	28	100	8,616	エネルギー
ALTAGAS LTD	36	20	50	4,359	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	36	—	—	—	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	18	13	50	4,284	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	27	19	39	3,366	不動産
INTER PIPELINE LTD	80	48	113	9,715	エネルギー

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46	15	41	3,558		エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	52	33	53	4,587		エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	2	194	16,610		ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	48	24	180	15,441		消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	9	81	6,946		素材
VERESEN INC	72	—	—	—		エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6	12	75	6,450		素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	83	59	27	2,342		各種金融
LINAMAR CORP	10	6	44	3,815		自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD	44	43	84	7,257		公益事業
EMERA INC	13	7	28	2,409		公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A	—	8	147	12,629		ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	—	63	399	34,161		素材
小 計	株 数 ・ 金 額	9,170	4,624	19,656	1,681,618	
	銘柄 数 < 比 率 >	91	88	—	< 3.5% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	233	118	127	16,676		銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	452	243	282	36,984		各種金融
CECONOMY AG	39	—	—	—		小売
SIEMENS AG-REG	167	82	951	124,323		資本財
RWE AG	108	56	114	14,926		公益事業
BASF SE	201	104	905	118,362		素材
VOLKSWAGEN AG	7	4	74	9,676		自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	210	109	734	96,010		自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	38	21	220	28,833		家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	441	236	220	28,826		公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	72	38	353	46,195		自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	181	88	907	118,588		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG	40	—	—	—		素材
ALLIANZ SE-REG	100	48	929	121,550		保険
MAN SE	7	4	44	5,812		資本財
CONTINENTAL AG	24	12	278	36,357		自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	247	124	298	39,056		半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	33	16	114	14,966		自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	52	22	57	7,473		運輸
HUGO BOSS AG -ORD	14	8	64	8,422		耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	212	100	345	45,192		運輸
SAP SE	214	106	1,036	135,436		ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	51	29	86	11,292		メディア
DEUTSCHE BOERSE AG	42	19	222	29,043		各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	47	26	224	29,384		ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	5	44	5,813		運輸
ADIDAS AG	41	21	409	53,541		耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	716	350	499	65,294		電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	35	16	324	42,472		保険
THYSSENKRUPP AG	80	47	110	14,468		素材
BEIERSDORF AG	21	10	102	13,428		家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	32	15	127	16,684		素材
MERCK KGAA	28	14	122	16,052		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	40	21	363	47,565		自動車・自動車部品
LANXESS AG	20	11	78	10,293		素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	89	45	300	39,295		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		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HOCHTIEF AG	4	3	45	5,960	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	77	40	162	21,192	不動産	
GEA GROUP AG	40	17	58	7,642	資本財	
SYMRIS AG	27	12	85	11,213	素材	
K+S AG-REG	42	24	60	7,851	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	22	11	108	14,246	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	26	11	63	8,235	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	12	7	59	7,806	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	13	5	61	8,062	保険	
BRENTAG AG	33	14	74	9,736	資本財	
AXEL SPRINGER SE	10	7	51	6,789	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	15	9	43	5,637	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	160	95	39	5,182	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	18	9	47	6,212	資本財	
VONOVIA SE	102	59	235	30,807	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	35	12	39	5,161	素材	
ZALANDO SE	18	15	68	8,954	小売	
COVESTRO AG	16	17	137	18,010	素材	
SCHAEFFLER AG	36	28	37	4,945	自動車・自動車部品	
UNIPER SE	—	28	76	10,036	公益事業	
INNOGY SE	31	21	78	10,234	公益事業	
METRO AG	—	22	26	3,505	食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	—	6	46	6,132	資本財	
LINDE AG - TENDER	—	19	371	48,522	素材	
I&I DRILLISCH AG	—	7	47	6,179	電気通信サービス	
MTU AERO ENGINES AG	—	5	76	10,031	資本財	
WIRECARD AG	—	12	151	19,845	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	—	17	57	7,466	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数	5,103	2,728	13,494	1,763,907	
	銘柄 数 < 比 率 >	56	62	—	< 3.7% >	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	256	131	217	28,449	保険	
INTESA SANPAOLO	2,786	1,419	446	58,356	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	2,498	1,559	125	16,392	電気通信サービス	
ENI SPA	557	270	445	58,202	エネルギー	
UNICREDIT SPA	413	229	412	53,871	銀行	
ENEL SPA	1,678	920	466	61,002	公益事業	
SAIPEM SPA	1,333	—	—	—	エネルギー	
RECORDATI SPA	—	14	42	5,609	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	90	51	145	18,977	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	196	106	35	4,585	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	37	17	90	11,878	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	123	48	48	6,362	銀行	
SNAM SPA	540	224	86	11,366	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RSP	1,325	360	25	3,320	電気通信サービス	
LEONARDO SPA	88	31	30	3,927	資本財	
TERNA SPA	340	132	64	8,453	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	236	108	23	3,097	保険	
PRYSMIAN SPA	42	27	73	9,615	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	86	53	7,016	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	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
POSTE ITALIANE SPA	115	81	66	8,655	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,660	5,822	2,900	379,142	
	銘柄 数 < 比 率 >	18	19	—	< 0.8% >	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	39	16	193	25,343	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	61	29	879	114,937	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	106	62	126	16,527	自動車・自動車部品	
AXA SA	424	220	495	64,775	保険	
DANONE	129	63	408	53,455	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	124	60	99	13,066	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	225	112	260	34,107	メディア	
INGENICO GROUP	12	8	60	7,854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	167	88	378	49,412	銀行	
AIR LIQUIDE SA	85	46	505	66,070	素材	
TOTAL SA	498	269	1,438	188,064	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	109	55	249	32,639	資本財	
ZODIAC AEROSPACE	44	—	—	—	資本財	
VINCI SA	110	55	474	61,964	資本財	
SANOFI	254	128	819	107,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	107	50	104	13,721	公益事業	
L'OREAL	55	26	534	69,877	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	37	24	114	14,996	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	122	59	453	59,212	資本財	
BNP PARIBAS	245	127	799	104,519	銀行	
ESSILOR INTERNATIONAL	45	22	256	33,477	ヘルスケア機器・サービス	
CAPGEMINI SE	35	19	220	28,771	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	12	7	30	3,991	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	52	28	164	21,555	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	5	3	212	27,785	耐久消費財・アパレル	
SODEXO SA	20	9	78	10,275	消費者サービス	
KERING	16	8	428	55,948	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	28	14	162	21,216	ソフトウェア・サービス	
CHRISTIAN DIOR SE	11	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ATOS SE	19	9	109	14,273	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	436	227	346	45,233	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	38	26	54	7,153	保険	
IMERYS SA	7	5	37	4,851	素材	
SAFRAN SA	68	37	376	49,225	資本財	
RENAULT SA	42	23	206	27,035	自動車・自動車部品	
PUBLICIS GROUPE	42	22	137	17,921	メディア	
LAGARDERE SCA	26	18	42	5,611	メディア	
JCDECAUX SA	15	9	28	3,755	メディア	
SOCIETE BIC SA	6	4	36	4,807	商業・専門サービス	
BOUYGUES SA	45	22	95	12,432	資本財	
THALES SA	22	10	117	15,388	資本財	
PERNOD RICARD SA	46	23	319	41,791	食品・飲料・タバコ	
CREDIT AGRICOLE SA	246	116	157	20,590	銀行	
ENGIE	352	207	304	39,760	公益事業	
ALSTOM	34	9	36	4,736	資本財	
ARKEMA	14	4	51	6,671	素材	
LEGRAND SA	58	32	212	27,807	資本財	
SCOR SE	35	14	48	6,374	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		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ADP	6	4	75	9,874	運輸	
EDF	61	51	62	8,231	公益事業	
NATIXIS	213	129	90	11,779	各種金融	
WENDEL	6	4	54	7,144	各種金融	
BUREAU VERITAS SA	58	22	48	6,351	商業・専門サービス	
EURAZEO SA	8	5	41	5,461	各種金融	
SUEZ	78	30	35	4,655	公益事業	
EIFFAGE	13	5	52	6,850	資本財	
ILIAD SA	5	2	36	4,773	電気通信サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	36	23	41	5,465	メディア	
BIOMERIEUX	—	6	42	5,495	ヘルスケア機器・サービス	
GETLINK SE	102	66	78	10,293	運輸	
EDENRED	45	31	88	11,632	商業・専門サービス	
REMY COINTREAU	5	3	39	5,151	食品・飲料・タバコ	
REXEL SA	66	41	54	7,162	資本財	
BOLLORE	194	118	52	6,849	運輸	
SFR GROUP SA	20	—	—	—	電気通信サービス	
DASSAULT AVIATION SA	0.5	0.33	56	7,332	資本財	
SEB SA	5	3	48	6,318	耐久消費財・アパレル	
IPSEN	—	4	64	8,387	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	—	4	32	4,237	各種金融	
FAURECIA	—	4	28	3,754	自動車・自動車部品	
TELEPERFORMANCE	—	5	69	9,136	商業・専門サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	—	9	82	10,732	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数	金 額	5,679	3,025	13,948	1,823,182
銘 柄 数 < 比 率 >	66	69	—	< 3.8% >		
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.	49	18	55	7,263	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CNH INDUSTRIAL NV	224	111	117	15,351	資本財	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	197	128	244	31,961	自動車・自動車部品	
FERRARI NV	27	12	144	18,905	自動車・自動車部品	
EXOR NV	23	14	94	12,349	各種金融	
AIRBUS SE	127	66	657	85,950	資本財	
STMICROELECTRONICS NV	139	71	143	18,817	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	17	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
WOLTERS KLUWER	66	34	161	21,080	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE KPN NV	747	357	90	11,863	電気通信サービス	
AKZO NOBEL	55	26	200	26,182	素材	
HEINEKEN NV	50	25	224	29,327	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	207	96	339	44,426	ヘルスケア機器・サービス	
RELX NV	218	112	201	26,342	商業・専門サービス	
AEGON NV	388	178	103	13,547	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	280	138	270	35,403	食品・生活必需品小売り	
RANDSTAD NV	26	11	61	8,084	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	22	11	100	13,194	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	39	21	182	23,821	素材	
ING GROEP NV	849	444	594	77,715	銀行	
ASML HOLDING NV	81	44	742	97,042	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	356	185	881	115,243	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	15	9	37	4,875	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	19	12	28	3,758	資本財	
NN GROUP NV	68	33	131	17,253	保険	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ALTICE NV - B	22	—	—	—	メディア	
ALTICE NV - A	82	69	53	7,001	メディア	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	64	45	120	15,733	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,470	2,282	5,986	782,494	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	26	—	< 1.6% >	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	—	40	56	7,355	資本財	
BANCO POPULAR ESPANOL	708	—	—	—	銀行	
ENDESA SA	70	46	91	11,901	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	41	22	81	10,698	資本財	
IBERDROLA SA	1,211	611	397	52,008	公益事業	
TELEFONICA SA	992	493	411	53,807	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	3,195	1,738	959	125,420	銀行	
BANKINTER SA	146	59	54	7,089	銀行	
REPSOL SA	246	143	239	31,261	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,438	753	516	67,528	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	77	32	71	9,357	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	237	126	339	44,325	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	141	73	134	17,611	運輸	
MAPPRE SA	232	144	42	5,524	保険	
FERROVIAL SA	106	37	67	8,791	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	106	—	—	—	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	44	—	—	—	資本財	
ENAGAS SA	50	32	79	10,361	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	96	41	72	9,428	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,159	523	90	11,865	銀行	
CAIXABANK S.A	785	412	177	23,206	銀行	
GRIFOLS SA	65	28	71	9,380	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	95	50	321	41,984	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	190	90	71	9,406	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	141	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	1,025	134	50	6,569	銀行	
AENA SME SA	14	7	132	17,261	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,623	5,647	4,530	592,148	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	23	—	< 1.2% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	42	18	82	10,738	保険	
UCB SA	27	16	104	13,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	17	7	71	9,341	各種金融	
UMICORE	20	25	122	15,957	素材	
COLRUYT SA	14	8	39	5,218	食品・生活必需品小売り	
KBC GROUP NV	54	26	188	24,598	銀行	
SOLVAY SA	16	7	86	11,336	素材	
PROXIMUS	34	20	50	6,543	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	12	6	34	4,509	メディア	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	166	86	691	90,392	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	408	224	1,470	192,247	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	< 0.4% >	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	66	33	129	16,892	銀行	
OMV AG	34	14	80	10,492	エネルギー	
VOESTALPINE AG	25	9	42	5,517	素材	

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…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ANDRITZ AG	16	9	43	5,667	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	25	20	57	7,573	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	167 5	87 5	353 —	46,143 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	8	6	43	5,688	メディア	
TENARIS SA	103	35	57	7,560	エネルギー	
SES	80	26	34	4,565	メディア	
EUROFINS SCIENTIFIC	2	0.9	40	5,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	402	81	244	32,000	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	597 5	149 5	421 —	55,057 <0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	1,278	647	346	45,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	120	52	90	11,815	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	25	15	48	6,364	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	116	58	182	23,808	素材	
FORTUM OYJ	98	43	86	11,330	公益事業	
KONE OYJ-B	73	39	167	21,853	資本財	
METSO OYJ	24	17	53	7,057	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	97	47	207	27,180	保険	
WARTSILA OYJ ABP	32	57	103	13,573	資本財	
ELISA OYJ	30	19	72	9,509	電気通信サービス	
NESTE OYJ	28	11	80	10,547	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	22	13	34	4,491	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,948 12	1,024 12	1,474 —	192,787 <0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	35	19	174	22,812	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	20	8	64	8,449	消費者サービス	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	59	44	5,784	銀行	
AIB GROUP PLC	—	124	62	8,142	銀行	
BANK OF IRELAND	6,176	—	—	—	銀行	
CRH PLC	184	95	291	38,150	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	6,416 4	306 5	637 —	83,339 <0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	539	338	105	13,754	公益事業	
JERONIMO MARTINS	56	30	41	5,450	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	110	48	82	10,773	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	705 3	417 3	229 —	29,978 <0.1%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	48	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	48 1	— —	— —	— <—%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	50,827 234	21,715 239	45,447 —	5,940,429 <12.5%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BARCLAYS PLC	3,705	1,791	384	56,955	銀行	
BP PLC	4,152	2,174	1,227	181,962	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,067	8,170	548	81,260	銀行	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC	276	135	714	106,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	86	37	61	9,180	資本財
NEXT PLC	30	14	81	12,038	小売
DIAGEO PLC	551	269	722	107,192	食品・飲料・タバコ
SKY PLC	227	116	158	23,533	メディア
BAE SYSTEMS PLC	694	384	244	36,189	資本財
UNILEVER PLC	280	132	547	81,200	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	1,793	1,110	273	40,602	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	238	101	161	23,956	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	355	142	41	6,210	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	138	75	434	64,494	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	564	295	569	84,491	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,304	687	192	28,504	保険
SAGE GROUP PLC/THE	236	113	76	11,386	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	4,339	2,197	1,616	239,723	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	408	249	962	142,662	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	154	95	72	10,805	公益事業
SCHRODERS PLC	29	17	60	8,946	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	773	392	115	17,136	銀行
BHP BILLITON PLC	462	245	420	62,321	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	209	96	268	39,753	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	281	146	192	28,543	メディア
CENTRICA PLC	1,206	562	82	12,274	公益事業
BT GROUP PLC	1,862	970	210	31,219	電気通信サービス
SSE PLC	226	112	157	23,417	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	719	380	292	43,428	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	402	201	168	25,007	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	28,578	14,324	1	212	資本財
COMPASS GROUP PLC	359	175	264	39,224	消費者サービス
KINGFISHER PLC	490	213	63	9,400	小売
PEARSON PLC	180	77	71	10,576	メディア
SEVERN TRENT PLC	53	36	72	10,711	公益事業
RIO TINTO PLC	272	130	550	81,587	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,067	528	774	114,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	32	—	—	—	各種金融
3I GROUP PLC	210	101	99	14,778	各種金融
GKN PLC	375	—	—	—	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	5,823	3,011	632	93,821	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	486	186	47	7,030	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	357	223	68	10,166	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	888	444	241	35,751	保険
CAPITA PLC	144	—	—	—	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	210	—	—	—	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	42	26	90	13,373	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	223	95	62	9,292	保険
WHITBREAD PLC	40	17	75	11,196	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	829	355	300	44,580	公益事業
FERGUSON PLC	55	29	167	24,789	資本財
BUNZL PLC	73	32	73	10,915	資本財
COBHAM PLC	375	311	36	5,422	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	306	145	271	40,237	素材
INTERTEK GROUP PLC	35	21	109	16,307	商業・専門サービス

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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
WILLIAM HILL PLC	191	—	—	—	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	97	44	79	11,813	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	39	18	86	12,809	消費者サービス
CARNIVAL PLC	41	19	94	13,966	消費者サービス
PERSIMMON PLC	67	32	89	13,331	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	168	106	52	7,719	資本財
ITV PLC	794	331	57	8,464	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	69	36	161	23,960	各種金融
G4S PLC	337	234	63	9,415	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	28	19	80	11,900	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	218	98	55	8,162	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	59	32	34	5,141	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	191	100	130	19,280	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	104	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	713	323	63	9,359	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	956	496	1,319	195,654	エネルギー
PETROFAC LTD	57	—	—	—	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	54	33	43	6,454	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	822	410	1,112	164,994	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	1,080	552	143	21,258	保険
INVESTEC PLC	142	88	51	7,678	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	433	286	106	15,754	各種金融
EXPERIAN PLC	209	108	187	27,860	商業・専門サービス
MONDI PLC	80	35	71	10,619	素材
WEIR GROUP PLC/THE	48	30	69	10,262	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	78	38	105	15,706	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	86	53	55	8,267	素材
SHIRE PLC	198	97	395	58,584	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	97	—	—	—	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	45	26	52	7,733	保険
FRESNILLO PLC	49	29	38	5,730	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	20	8	52	7,754	素材
BABCOCK INTL GROUP PLC	55	44	33	5,011	商業・専門サービス
ST JAMES' S PLACE PLC	115	48	57	8,486	各種金融
GLENCORE PLC	2,676	1,288	497	73,788	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	201	—	—	—	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC	56	22	42	6,233	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	28	12	56	8,421	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	552	128	19,107	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	38	26	65	9,744	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC	35	19	34	5,069	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	300	193	71	10,640	保険
ROYAL MAIL PLC	196	118	74	11,109	運輸
ASHTAD GROUP PLC	109	54	121	18,011	資本財
MERLIN ENTERTAINMENT	151	112	42	6,254	消費者サービス
TUI AG-DI	109	42	75	11,216	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	49	64	9,572	ソフトウェア・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	32	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	78	58	40	6,043	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	216	130	49	7,348	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY GROUP PLC	400	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DCC PLC	20	8	61	9,111	資本財

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円			
GVC HOLDINGS PLC	—	62	54	8,048			消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	—	186	42	6,311			ヘルスケア機器・サービス
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	52	34	5,050			エネルギー
小 計	株 数	金 額	93,700	48,691	21,641	3,208,805	
	銘柄 数 < 比 率 >		105	99	—	< 6.7% >	
(スイス)			千スイスフラン				
NESTLE SA-REG	682	343	2,662	291,404			食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	114	55	536	58,735			耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	435	282	484	52,982			各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	100	49	259	28,364			素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	154	77	1,710	187,251			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	2	1	244	26,769			素材
SONOVA HOLDING AG-REG	11	4	83	9,088			ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	32	15	504	55,213			保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	0.99	68	7,454			ヘルスケア機器・サービス
SYNGENTA AG-REG	20	—	—	—			素材
LONZA GROUP AG-REG	12	9	240	26,277			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	11	7	67	7,404			耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8	5	110	12,117			資本財
GEBERIT AG-REG	8	4	188	20,671			資本財
SWISS RE AG	70	36	342	37,535			保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	6	3	155	16,978			耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	7	6	59	6,566			各種金融
NOVARTIS AG-REG	489	243	1,890	206,907			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	35	17	110	12,080			商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	5	2	128	14,057			電気通信サービス
ABB LTD-REG	412	193	465	50,935			資本財
CLARIANT AG-REG	—	19	47	5,218			素材
SGS SA-REG	1	0.55	138	15,138			商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4	1	24	2,711			資本財
ACTELION LTD-REG	21	—	—	—			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	11	5	80	8,769			運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	11	4	68	7,485			保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7	3	121	13,248			保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.01	75	8,208			食品・飲料・タバコ
ARYZTA AG	19	—	—	—			食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	49	24	152	16,740			各種金融
SIKA AG-BR	0.47	0.25	203	22,243			素材
SWISS PRIME SITE-REG	15	9	93	10,206			不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.22	0.16	101	11,145			食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3	1	131	14,378			各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.49	0.31	56	6,177			食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	1	68	7,509			素材
UBS GROUP AG-REG	801	417	685	75,025			各種金融
DUFREY AG-REG	10	2	40	4,478			小売
VIFOR PHARMA AG	0.85	6	107	11,738			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	3,582	1,857	12,511	1,369,221	
	銘柄 数 < 比 率 >		38	37	—	< 2.9% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ				
ELECTROLUX AB-SER B	52	22	511	6,505			耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	672	296	2,026	25,780			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	85	44	1,411	17,949			資本財

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	333	182	1,556	19,793	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	99	53	2,048	26,052	各種金融	
NORDEA BANK AB	665	328	3,001	38,177	銀行	
GETINGE AB-B SHS	44	31	264	3,368	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	334	178	1,784	22,693	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	149	72	2,528	32,168	資本財	
SKF AB-B SHARES	87	36	668	8,498	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	219	120	2,314	29,434	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	207	116	1,616	20,562	小売	
SANDVIK AB	233	135	2,129	27,091	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	198	80	1,568	19,952	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	68	42	591	7,519	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	132	—	—	—	素材	
SKANSKA AB-B SHS	74	49	812	10,333	資本財	
SWEDISH MATCH AB	41	24	1,005	12,789	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	79	49	566	7,203	電気通信サービス	
TELIA CO AB	565	274	1,195	15,202	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	342	168	2,640	33,585	資本財	
ALFA LAVAL AB	63	26	593	7,543	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	40	24	656	8,349	エネルギー	
BOLIDEN AB	59	25	823	10,477	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	91	56	482	6,131	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	14	7	418	5,325	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	56	27	1,321	16,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINNEVIK AB - B	51	20	667	8,490	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	35	25	496	6,313	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	17	12	343	4,375	食品・生活必需品小売り	
LUNDBERGS AB-B SHS	8	5	339	4,316	各種金融	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	70	1,619	20,594	家庭用品・パーソナル用品	
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	—	44	35	449	資本財	
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	—	72	57	733	資本財	
小 計	株 数	5,127	2,726	38,095	484,569	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	33	—	< 1.0% >	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA	214	117	1,834	25,062	銀行	
NORSK HYDRO ASA	291	128	621	8,492	素材	
ORKLA ASA	178	110	821	11,224	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	251	117	2,548	34,808	エネルギー	
TELENOR ASA	164	83	1,443	19,718	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	38	16	552	7,541	素材	
MARINE HARVEST	84	38	646	8,831	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	43	21	273	3,742	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A	18	—	—	—	メディア	
SCHIBSTED ASA-B SHS	18	13	291	3,986	メディア	
小 計	株 数	1,303	647	9,034	123,408	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	9	—	< 0.3% >	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	418	213	6,398	112,223	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	50	24	774	13,590	素材	
DANSKE BANK A/S	151	81	1,761	30,895	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	26	16	380	6,672	ヘルスケア機器・サービス	
H LUNDBECK A/S	—	8	357	6,276	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株		千デンマーククローネ	千円	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	48	23		1,052	18,464	資本財
TDC A/S	174	—		—	—	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	23	11		797	13,985	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	26	11		711	12,473	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	41	20		1,051	18,451	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1	0.92		969	17,000	運輸
TRYG A/S	24	14		214	3,767	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.79	0.3		297	5,225	運輸
PANDORA A/S	24	11		771	13,524	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	36	23		519	9,105	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	21	9		559	9,806	素材
GENMAB A/S	13	6		748	13,135	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S	34	19		769	13,490	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,118	497	18,135	318,088	
(オーストラリア)		17	17		<0.7%>	
BHP BILLITON LIMITED	704	369		千オーストラリアドル 1,224	101,181	素材
CSL LTD	100	51		910	75,271	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	545	328		90	7,468	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	167	104		349	28,912	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	643	330		931	76,975	銀行
RIO TINTO LTD	93	49		418	34,563	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	303	141		144	11,940	保険
LENLEASE GROUP	123	74		134	11,157	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	379	195		1,376	113,801	銀行
WESTPAC BANKING CORP	735	382		1,131	93,519	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	584	301		856	70,837	銀行
BRAMBLES LTD	354	168		165	13,698	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	113	—		—	—	運輸
BORAL LTD	261	172		117	9,674	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	285	142		407	33,669	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	929	462		148	12,241	電気通信サービス
AMP LTD	658	303		113	9,342	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	190	233		106	8,784	消費者サービス
AMCOR LIMITED	257	131		182	15,085	素材
COMPUTERSHARE LTD	107	65		115	9,523	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	121	54		153	12,705	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	67	38		438	36,276	各種金融
CIMIC GROUP LTD	21	13		60	4,983	資本財
ASX LTD	43	25		159	13,207	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	127	74		67	5,558	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	12	5		104	8,602	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	100	63		149	12,329	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	124	102		35	2,931	小売
NEWCREST MINING LTD	169	85		189	15,678	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	530	244		201	16,621	保険
ORIGIN ENERGY LTD	389	176		173	14,378	エネルギー
ORICA LTD	83	56		103	8,564	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	89	34		81	6,699	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	405	168		104	8,649	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	288	143		199	16,463	保険
TRANSURBAN GROUP	458	251		298	24,642	運輸

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		
WESFARMERS LTD	248	133	587	48,602	食品・生活必需品小売り	
BLUESCOPE STEEL LTD	—	46	82	6,815	素材	
CHALLENGER LTD	128	81	102	8,479	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	252	169	120	9,987	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	58	22	69	5,751	エネルギー	
OIL SEARCH LTD	305	131	111	9,206	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	152	70	155	12,878	公益事業	
TATTS GROUP LTD	317	—	—	—	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	342	221	109	9,019	素材	
AUSNET SERVICES	485	268	46	3,855	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	81	64	86	7,190	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	386	224	78	6,526	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	106	66	71	5,877	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	459	177	78	6,467	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	164	73	138	11,442	食品・飲料・タバコ	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	32	12	81	6,714	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	11	9	58	4,850	消費者サービス	
SEEK LTD	72	51	106	8,777	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	91	54	55	4,551	銀行	
REA GROUP LTD	11	8	73	6,100	ソフトウェア・サービス	
TPG TELECOM LTD	76	63	36	3,048	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	397	211	52	4,319	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	616	408	123	10,237	保険	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	15	11	46	3,884	消費者サービス	
SOUTH32 LTD	1,169	556	219	18,120	素材	
VOCUS GROUP LTD	114	—	—	—	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	16,672	8,689	14,138	1,168,647	
	銘柄 数 < 比 率 >	61	59	—	< 2.5% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	397	241	85	6,520	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	209	61	40	3,124	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	165	—	—	—	公益事業	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	—	77	101	7,702	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	151	74	47	3,626	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	82	50	57	4,365	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	290	36	10	820	公益事業	
MERCURY NZ LTD	153	127	40	3,085	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,449	669	383	29,244	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	300	170	437	6,097	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	120	70	554	7,717	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	593	318	2,939	40,949	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	320	160	2,032	28,305	不動産	
MTR CORP	320	145	659	9,180	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	1,733	984	1,657	23,085	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,250	580	673	9,388	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	310	140	830	11,574	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	255	128	3,353	46,715	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	260	—	—	—	運輸	
HANG LUNG GROUP LTD	190	140	343	4,787	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	490	140	260	3,635	不動産	

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		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
CLP HOLDINGS LTD	360	185	1,523	21,222	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	242	164	834	11,620	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	262	170	583	8,129	銀行	
HANG SENG BANK LTD	163	93	1,874	26,117	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	100	444	6,191	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	260	200	296	4,134	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	60	34	345	4,816	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	690	230	304	4,241	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	165	95	213	2,977	耐久消費財・アパレル	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	50	314	4,384	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	815	380	1,544	21,517	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	305	135	646	9,007	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	1,010	530	259	3,610	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	1,300	720	310	4,322	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	155	95	367	5,121	不動産	
MINTH GROUP LTD	—	100	384	5,349	自動車・自動車部品	
NWS HOLDINGS LTD	350	200	296	4,128	資本財	
SANDS CHINA LTD	532	268	1,268	17,676	消費者サービス	
WHEELLOCK & CO LTD	180	110	625	8,718	不動産	
WYNN MACAU LTD	336	216	645	8,996	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	470	280	252	3,514	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	440	240	96	1,347	各種金融	
ATA GROUP LTD	2,642	1,382	10,060	140,149	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	248	154	463	6,457	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	520	280	1,946	27,107	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	112	256	3,572	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	820	510	534	7,445	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	1,785	855	681	9,492	食品・飲料・タバコ	
CK ASSET HOLDINGS LTD	588	273	1,864	25,966	不動産	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	—	600	238	3,326	各種金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	170	1,052	14,658	不動産	
小計	株数・金額	21,330	11,907	44,275	616,761	
	銘柄数<比率>	40	42	—	<1.3%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	694	342	449	36,849	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	372	207	57	4,701	メディア	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	238	123	38	3,126	資本財	
CAPITALAND LTD	577	209	76	6,289	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	89	68	85	6,986	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	21	12	40	3,329	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	390	201	592	48,572	銀行	
KEPPEL CORP LTD	323	134	110	9,076	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	291	146	433	35,508	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	342	223	75	6,198	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,791	841	298	24,481	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	125	84	93	7,680	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	177	113	87	7,144	各種金融	
UOL GROUP LTD	107	75	65	5,362	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	472	282	65	5,387	運輸	
STARHUB LTD	127	127	27	2,270	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,525	1,292	47	3,868	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	442	202	63	5,234	食品・飲料・タバコ	

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	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
GENTING SINGAPORE PLC	1,381	897	114	9,414		消費者サービス
SATS LTD	160	125	69	5,709		運輸
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	586	—	—	—		不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	378	291	34	2,839		資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	10,608	5,994	2,927	240,034	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	21	—	< 0.5% >	
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	107	93	154	4,735		素材
BANK HAPOALIM BM	234	89	232	7,110		銀行
NICE LTD	13	8	305	9,324		ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	317	124	274	8,387		銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	5	2	118	3,617		資本財
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	438	255	107	3,270		電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	28	16	114	3,494		銀行
AZRIELI GROUP LTD	8	7	125	3,823		不動産
FRUTAROM	9	5	172	5,273		素材
小 計	株 数 ・ 金 額	1,163	604	1,604	49,036	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 0.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	284,397	142,351	—	44,014,672	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,261	1,261	—	< 92.3% >	

(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	10	4	117	12,842	0.0	
MACERICH CO/THE	2	1	61	6,672	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	0.997	127	13,954	0.0	
PROLOGIS INC	11	5	385	42,126	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	0.849	74	8,111	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	2	84	9,253	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	1	217	23,724	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	0.75	181	19,875	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	1	121	13,275	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	0.692	82	8,969	0.0	
WELLTOWER INC	7	4	255	27,964	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3	1	231	25,288	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	1	109	11,994	0.0	
REALTY INCOME CORP	5	3	161	17,695	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	3	1	90	9,894	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	2	0.748	74	8,182	0.0	
UDR INC	5	2	99	10,837	0.0	
VENTAS INC	7	3	199	21,811	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	22	12	126	13,868	0.0	
WEYERHAEUSER CO	16	8	299	32,776	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	9	4	683	74,664	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	7	5	99	10,826	0.0	
VEREIT INC	21	13	97	10,628	0.0	
DUKE REALTY CORP	7	3	95	10,491	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6	4	62	6,810	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	5	2	85	9,309	0.0	
EQUINIX INC	1	0.899	361	39,493	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	7	4	492	53,864	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	7	3	240	26,275	0.1	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	11	7	46	5,032	0.0	
INVITATION HOMES INC	—	2	64	7,027	0.0	
GGP INC	12	6	140	15,411	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	16	7	163	17,833	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	2	89	9,729	0.0	
PUBLIC STORAGE	3	1	385	42,189	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6	3	520	56,854	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	3	1	130	14,312	0.0	
KIMCO REALTY CORP	9	3	57	6,277	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	1	220	24,134	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	262	143	7,138	780,285	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	39	—	<1.6%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1	0.9	25	2,206	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	%
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		2	1	33	2,860	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3	2	47	4,092	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	7	4	107	9,160	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		0.888	0.418	61	7,982	0.0
KLEPIERRE		4	2	70	9,222	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	1	206	26,926	0.1
FONCIERE DES REGIONS		0.804	0.467	44	5,859	0.0
ICADE		0.812	0.44	35	4,598	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	9	4	417	54,590	
	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		21	9	64	9,502	0.0
HAMMERSON PLC		17	10	61	9,152	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		17	7	69	10,283	0.0
INTU PROPERTIES PLC		20	—	—	—	—
SEGRO PLC		18	13	90	13,425	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	95	41	285	42,364	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		75	29	74	6,165	0.0
SCENTRE GROUP		118	61	251	20,812	0.0
GPT GROUP		40	15	77	6,441	0.0
MIRVAC GROUP		83	56	128	10,586	0.0
STOCKLAND		54	22	93	7,758	0.0
WESTFIELD CORP		43	21	195	16,162	0.0
DEXUS		21	13	128	10,624	0.0
GOODMAN GROUP		40	18	172	14,249	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	477	238	1,122	92,800	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 0.2% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		49	22	1,522	21,203	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	49	22	1,522	21,203	
	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		52	32	61	5,043	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		45	39	70	5,776	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		56	32	67	5,562	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		54	36	97	8,013	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	208	140	297	24,395	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,110	595	—	1,024,798	
	銘柄 数 < 比 率 >	64	64	—	< 2.1% >	

(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) 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	SP EMINI	1,670	—
		SP/TSE60	97	—
		SWISS IX	78	—
		EURO ST	382	—
		SPI 200	50	—
		FTSE100	171	—

(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

(2018年5月14日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	44,014,672	91.0
投資証券	1,024,798	2.1
コール・ローン等、その他	3,317,677	6.9
投資信託財産総額	48,357,147	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（47,654,728千円）の投資信託財産総額（48,357,147千円）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=109.31円	1 カナダドル=85.55円	1 ユーロ=130.71円	1 イギリスポンド=148.27円
1 スイスフラン=109.44円	1 スウェーデンクローネ=12.72円	1 ノルウェークローネ=13.66円	1 デンマーククローネ=17.54円
1 オーストラリアドル=82.66円	1 ニュージーランドドル=76.25円	1 香港ドル=13.93円	1 シンガポールドル=82.00円
1 イスラエルシェゲル=30.56円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月14日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	94,735,398,934
コール・ローン等	1,195,736,981
株式(評価額)	44,014,672,109
投資証券(評価額)	1,024,798,444
未収入金	48,023,519,597
未収配当金	87,831,963
差入委託証拠金	388,839,840
(B) 負債	47,050,566,516
未払金	46,423,630,335
未払解約金	626,935,513
未払利息	668
(C) 純資産総額(A-B)	47,684,832,418
元本	27,311,888,003
次期繰越損益金	20,372,944,415
(D) 受益権総口数	27,311,888,003口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,459円

<注記事項>

- ①期首元本額 54,368,337,558円
 期中追加設定元本額 15,828,298,960円
 期中一部解約元本額 42,884,748,515円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7459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)

つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)	11,958,435円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	2,738,719,071円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	2,370,381,270円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	349,413,518円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	36,693,539円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,836,708,949円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,953,100,458円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	17,014,333,444円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	579,319円
合計	27,311,888,003円

【お知らせ】

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。(2017年8月16日)
- ②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)

○損益の状況 (2017年5月13日～2018年5月14日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,352,218,392
受取配当金	1,337,230,763
受取利息	4,075,425
その他収益金	16,290,045
支払利息	△ 5,377,841
(B) 有価証券売買損益	5,120,928,252
売買益	16,012,808,767
売買損	△10,891,880,515
(C) 先物取引等取引損益	122,259,949
取引益	592,711,657
取引損	△ 470,451,708
(D) 保管費用等	△ 40,398,352
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	6,555,008,241
(F) 前期繰越損益金	31,280,617,643
(G) 追加信託差損益金	10,407,010,748
(H) 解約差損益金	△27,869,692,217
(I) 計(E+F+G+H)	20,372,944,415
次期繰越損益金(I)	20,372,944,415

(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。