

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「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2期（決算日：2019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2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 配	込 み 金	期 騰 落	中 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
2期(2019年6月25日)	11,484	0	5.0	394.03	3.1	91.7	5.6	2.5	128

(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 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 書 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2018年6月25日	10,939	—	382.34	—	89.8	9.2	2.1
6月末	10,777	△ 1.5	376.50	△ 1.5	89.9	9.2	2.2
7月末	11,102	1.5	387.57	1.4	93.2	5.5	2.2
8月末	11,332	3.6	394.84	3.3	92.4	7.4	2.2
9月末	11,351	3.8	394.81	3.3	91.0	6.5	2.1
10月末	10,438	△ 4.6	363.08	△ 5.0	89.5	7.4	2.2
11月末	10,619	△ 2.9	368.73	△ 3.6	88.2	9.9	2.2
12月末	9,735	△11.0	337.75	△11.7	92.2	3.5	2.4
2019年1月末	10,478	△ 4.2	363.72	△ 4.9	93.1	3.3	2.4
2月末	10,915	△ 0.2	378.08	△ 1.1	95.1	4.0	2.4
3月末	11,001	0.6	380.18	△ 0.6	91.4	6.0	2.4
4月末	11,431	4.5	394.11	3.1	90.5	6.7	2.3
5月末	10,954	0.1	376.03	△ 1.7	92.6	2.2	2.5
(期 末) 2019年6月25日	11,484	5.0	394.03	3.1	91.7	5.6	2.5

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第2期：2018年6月26日～2019年6月25日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第2期首	10,939円
第2期末	11,484円
既払分配金	0円
騰落率	5.0%

※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、ファンドの購入価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。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.0%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（3.1%）を1.9%上回りました。

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。

第2期：2018年6月26日～2019年6月25日

投資環境について

▶ 外国株式市況

外国株式市況は、上昇しました。

外国株式市況は、米国の堅調な企業決算内容などが好感され、上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

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。

▶ 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・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

▶ つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）

ベンチマークとの乖離は1.9%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2.1%程度でした。

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[※] 2.2%

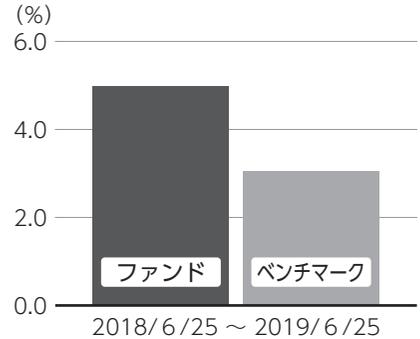
※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

主なマイナス要因： 取引要因

為替ヘッジに係る要因[※]

※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。

基準価額（ベビーファンド）と
ベンチマークの対比（騰落率）



▶ 分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第2期 2018年6月26日～2019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	1,483

（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）**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。
- ▶ **ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
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を維持するため、為替ヘッジを行います。

2018年6月26日～2019年6月25日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	24	0.217	(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）	(11)	(0.097)	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）	(11)	(0.097)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.022)	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	0.005	(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)	(0.002)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.003)	
(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	4	0.041	(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）	(4)	(0.035)	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)	(0.003)	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	0.272	

期中の平均基準価額は、10,885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。

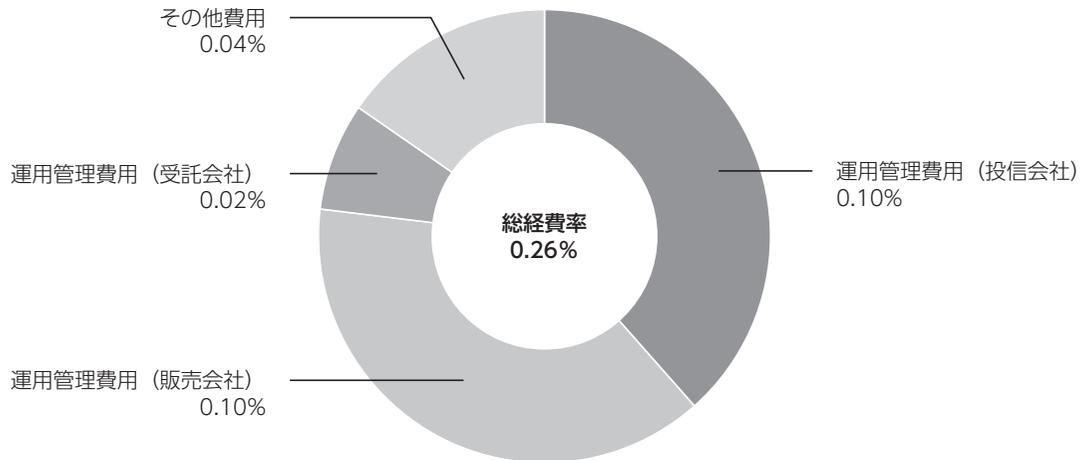
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.26%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2018年6月26日～2019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 55,170	千円 95,881	千口 914	千円 1,555

○株式売買比率

(2018年6月26日～2019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	13,056,667千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	43,100,152千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.30	

(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

(2018年6月26日～2019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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	553,513	298,094	53.9	552,164	297,580	53.9
為替直物取引	6,138	3,929	64.0	8,021	2,618	32.6

平均保有割合 0.2%

※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。

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2018年6月26日～2019年6月25日)

期首残高(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 1	百万円 -	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2019年6月25日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
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	千口 69,984	千円 128,947

○投資信託財産の構成

(2019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 128,947	% 99.5
コール・ローン等、その他	650	0.5
投資信託財産総額	129,597	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（47,523,339千円）の投資信託財産総額（49,367,389千円）に対する比率は96.3%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=107.28円	1 カナダドル=81.40円	1 ユーロ=122.31円	1 イギリスポンド=136.67円
1 スイスフラン=110.36円	1 スウェーデンクローネ=11.56円	1 ノルウェークローネ=12.65円	1 デンマーククローネ=16.38円
1 オーストラリアドル=74.60円	1 ニュージーランドドル=71.20円	1 香港ドル=13.74円	1 シンガポールドル=79.30円
1 イスラエルシェケル=29.81円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年6月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	129,597,700
コール・ローン等	650,380
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	128,947,320
(B) 負債	635,076
未払解約金	530,639
未払信託報酬	102,900
未払利息	1
その他未払費用	1,536
(C) 純資産総額(A－B)	128,962,624
元本	112,300,071
次期繰越損益金	16,662,553
(D) 受益権総口数	112,300,071口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,484円

<注記事項>

- ①期首元本額 25,183,245円
 期中追加設定元本額 94,101,839円
 期中一部解約元本額 6,985,013円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1484円です。

○損益の状況（2018年6月26日～2019年6月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 17
支払利息	△ 17
(B) 有価証券売買損益	6,975,874
売買益	7,260,024
売買損	△ 284,150
(C) 信託報酬等	△ 155,069
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,820,788
(E) 前期繰越損益金	542,465
(F) 追加信託差損益金	9,299,300
(配当等相当額)	(2,435,051)
(売買損益相当額)	(6,864,249)
(G) 計(D+E+F)	16,662,553
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	16,662,553
追加信託差損益金	9,299,300
(配当等相当額)	(2,593,104)
(売買損益相当額)	(6,706,196)
分配準備積立金	7,363,253

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

②分配金の計算過程

項 目	2018年6月26日～ 2019年6月25日
費用控除後の配当等収益額	1,736,137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	5,084,651円
収益調整金額	9,299,300円
分配準備積立金額	542,465円
当ファンドの分配対象収益額	16,662,553円
1万口当たり収益分配対象額	1,483円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

*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】

2014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12期》決算日2019年5月13日

[計算期間：2018年5月15日～2019年5月13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13日に第12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12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
	円	騰落率	騰落率	騰落率				
8期(2015年5月12日)	13,927	13.2%	325.42	10.6%	95.5%	2.4%	2.2%	91,128 百万円
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
12期(2019年5月13日)	17,997	3.1%	386.19	1.0%	88.9%	6.8%	2.3%	49,740

(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) 2018年5月14日	円	%	382.52	%	%	%	%
5月末	17,459	—	379.21	—	92.3	5.1	2.1
6月末	17,342	△ 0.7	376.50	△ 0.9	90.3	6.3	2.1
7月末	17,254	△ 1.2	376.50	△ 1.6	89.9	9.2	2.2
8月末	17,777	1.8	387.57	1.3	93.2	5.5	2.2
9月末	18,149	4.0	394.84	3.2	92.4	7.4	2.2
10月末	18,182	4.1	394.81	3.2	91.0	6.5	2.1
11月末	16,724	△ 4.2	363.08	△ 5.1	89.5	7.4	2.2
12月末	17,017	△ 2.5	368.73	△ 3.6	88.2	9.9	2.2
2019年1月末	15,602	△10.6	337.75	△11.7	92.2	3.5	2.4
2月末	16,796	△ 3.8	363.72	△ 4.9	93.2	3.3	2.4
3月末	17,500	0.2	378.08	△ 1.2	95.1	4.0	2.4
4月末	17,641	1.0	380.18	△ 0.6	91.4	6.0	2.4
4月末	18,333	5.0	394.11	3.0	90.5	6.7	2.3
(期 末) 2019年5月13日	円	%	386.19	1.0	88.9	6.8	2.3

(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

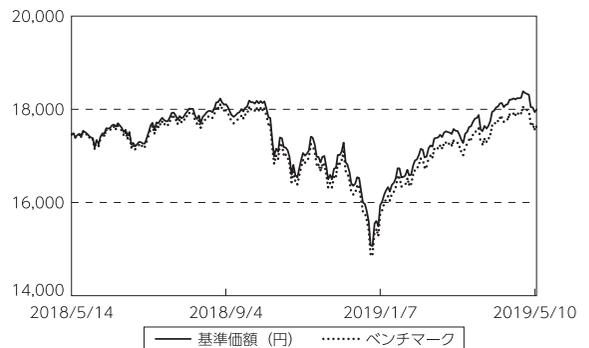
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.1%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(1.0%)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

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・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・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

- ・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1.0%の上昇となったため、カイ離は2.1%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※ 2.2%

※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)

- ・取引要因
- ・為替ヘッジに係る要因※

※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

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・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

(2018年5月15日～2019年5月13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) (先物・オプション)	円 1 (0) (0) (0)	% 0.004 (0.002) (0.000) (0.002)	(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)	1 (1) (0)	0.008 (0.008) (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)	6 (5) (1)	0.033 (0.029) (0.004)	(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	8	0.045	
期中の平均基準価額は、17,389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

(2018年5月15日～2019年5月13日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 5,054 (471)	千アメリカドル 39,055 (818)	百株 5,051 (362)	千アメリカドル 38,570 (3,372)
	カナダ	974 (49)	千カナダドル 3,512 (135)	747 (97)	千カナダドル 2,841 (178)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	321 (74)	1,866 (△ 446)	437	1,794
	イタリア	727 (138)	481 (35)	674 (106)	442 (35)
	フランス	502 (4)	2,147 (△0.85199)	482	1,846
	オランダ	288 (△ 115)	954 (△ 222)	352	972
	スペイン	1,033 (3,492)	729 (46)	4,134 (181)	843 (6)
	ベルギー	17	130	21	159
	オーストリア	9 (-)	34 (△ 3)	-	-
	ルクセンブルク	162	204	33	76
	フィンランド	150 (28)	179 (-)	167	176
	アイルランド	168 (30)	329 (380)	137	597
	ポルトガル	53	18	105	34
	イギリス	- (112)	- (201)	112	198
	イギリス	4,130 (21,171)	千イギリスポンド 3,170 (△ 56)	4,897 (22,209)	千イギリスポンド 3,769 (2)
	スイス	272 (73)	千スイスフラン 1,842 (△ 46)	235 (9)	千スイスフラン 1,654 (0.64641)
	スウェーデン	401 (148)	千スウェーデンクローネ 5,620 (-)	370 (141)	千スウェーデンクローネ 5,987 (107)
	ノルウェー	182 (13)	千ノルウェークローネ 2,627 (-)	181	千ノルウェークローネ 2,159

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 57 (2)	千デンマーククローネ 2,438 (-)	百株 69	千デンマーククローネ 2,762
	オーストラリア	1,146 (218)	千オーストラリアドル 2,091 (48)	1,510 (55)	千オーストラリアドル 2,424 (4)
	ニュージーランド	416	千ニュージーランドドル 256	346	千ニュージーランドドル 155
国	香港	1,947 (107)	千香港ドル 7,868 (-)	3,245	千香港ドル 8,491
	シンガポール	768	千シンガポールドル 486	1,157	千シンガポールドル 563
	イスラエル	151 (△ 3)	千イスラエルシェケル 504 (-)	70 (-)	千イスラエルシェケル 484 (130)

(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
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.597	77	0.288	39
	PROLOGIS INC	1	67	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.206	20	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.999	112	0.695	79
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.155	20	—	—
	WELLTOWER INC	1	78	1	89
	BOSTON PROPERTIES INC	0.461	60	0.611	77
	REALTY INCOME CORP	0.289	20	—	—
	SL GREEN REALTY CORP	0.499	52	0.415	39
	VENTAS INC	0.334	21	—	—
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3	39	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	0.501	89	0.497	78
	WP CAREY INC	1	112	—	—
	VEREIT INC	7	60	10	78
	DUKE REALTY CORP	0.678	20	—	—
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	—	4	67
	IRON MOUNTAIN INC	0.59	20	—	—
	EQUINIX INC	0.182	76	0.184	78
	CROWN CASTLE INTL CORP	1	122	1	128
	EQUITY RESIDENTIAL	0.764	51	0.612	39
	COLONY CAPITAL INC	—	—	7	43
	INVITATION HOMES INC	0.873	20	—	—
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	1	21	1	37
	GGP INC	(2)	(60)	—	—
				(6)	(140)
	PUBLIC STORAGE	0.321	69	0.387	78
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.471	78	0.261	45
	KIMCO REALTY CORP	1	21	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.632	113	0.422	78
	小計	27 (2)	1,450 (60)	30 (6)	1,081 (140)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス					
UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	—	—	
			(1)	(206)	
小計	—	—	(1)	(206)	

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	オランダ				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.468 (1)	88 (206)	—	—
	小計	0.468 (1)	88 (206)	—	—
	ユーロ計	0.468 (1)	88 (206)	— (1)	— (206)
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	SEGRO PLC	4	29	4	30
	小計	4	29	4	30
	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
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD/CDI	— (7)	— (117)	7	115
	ONEMARKET LTD	— (1)	— (1)	1	1
	MIRVAC GROUP	39	94	55	133
	WESTFIELD CORP	—	—	— (21)	— (195)
	DEXUS	2	29	4	51
	小計	41 (9)	124 (119)	69 (21)	301 (195)
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	— (—)	— (△0.46914)	—	—
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	14	27	26	51
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	35 (—)	99 (△0.55363)	45	118
	小計	49 (—)	126 (△ 1)	71	169

(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 28,023	百万円 27,164	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

(2018年5月15日～2019年5月13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	13,475,818千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	43,058,650千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.31

(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

(2018年5月15日～2019年5月13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	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 551,006	百万円 279,910	50.8	百万円 551,897	百万円 281,563	51.0
為替直物取引	5,174	2,965	57.3	7,636	2,055	26.9

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UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2019年5月13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	79	81	961	105,493	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	188	196	1,500	164,612	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	37	35	271	29,807	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5	5	53	5,914	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	46	48	787	86,395	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	8	—	—	—	小売
AES CORP	57	76	124	13,652	公益事業
AFLAC INC	91	86	445	48,932	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	103	99	515	56,545	保険
APACHE CORP	41	41	131	14,386	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	80	105	295	32,441	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5	5	78	8,600	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	66	71	1,245	136,629	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	25	24	513	56,298	素材
ANTHEM INC	27	28	774	84,976	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	58	56	409	44,930	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	157	153	563	61,808	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	56	56	427	46,893	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	62	60	2,138	234,657	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	30	29	674	74,057	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	33	26	186	20,443	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	174	182	857	94,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	13	13	615	67,576	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	450	461	2,627	288,351	電気通信サービス
BALL CORP	35	35	229	25,194	素材
ALLSTATE CORP	42	37	364	39,958	保険
AVERY DENNISON CORP	12	10	110	12,114	素材
CHUBB LTD	53	51	748	82,192	保険
ANALOG DEVICES INC	42	41	456	50,126	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	3	2	278	30,525	小売
CVS HEALTH CORP	115	144	797	87,511	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	99	88	271	29,764	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	384	372	4,185	459,364	銀行
CIGNA CORP	26	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	67	65	865	95,012	資本財
COCA-COLA CO/THE	446	452	2,179	239,193	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	50	53	486	53,376	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	16	22	87	9,552	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	93	89	705	77,468	運輸
CHEVRON CORP	211	213	2,609	286,325	エネルギー
TAPESTRY INC	29	29	95	10,472	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	19	—	—	—	資本財
CONOCOPHILLIPS	129	128	794	87,140	エネルギー
CME GROUP INC	38	39	731	80,223	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	37	34	166	18,258	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	95	92	659	72,422	家庭用品・パーソナル用品

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	
DOMINION ENERGY INC	73	84	631	69,286	公益事業
DEVON ENERGY CORP	62	52	163	17,939	エネルギー
DEERE & CO	30	34	531	58,361	資本財
DANAHER CORP	71	70	927	101,804	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	166	200	2,693	295,617	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	12	14	177	19,466	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	80	80	705	77,431	公益事業
DR HORTON INC	39	39	173	19,093	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	57	55	413	45,369	小売
DAVITA INC	16	16	84	9,252	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	16	16	161	17,688	資本財
DTE ENERGY COMPANY	22	20	257	28,216	公益事業
EXXON MOBIL CORP	470	473	3,627	398,097	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24	23	424	46,604	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	66	64	613	67,284	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	70	69	467	51,355	資本財
EXELON CORP	100	108	536	58,839	公益事業
ECOLAB INC	28	28	518	56,889	素材
EQUIFAX INC	13	13	157	17,322	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	24	24	403	44,295	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	51	48	399	43,792	資本財
EDISON INTERNATIONAL	40	37	224	24,656	公益事業
ENTERGY CORP	19	19	184	20,286	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	3	3	99	10,891	保険
NEXTERA ENERGY INC	53	53	1,028	112,878	公益事業
MACY'S INC	42	39	87	9,656	小売
FEDEX CORP	29	28	498	54,753	運輸
FORD MOTOR CO	410	410	425	46,737	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	35	35	120	13,191	各種金融
FIRSTENERGY CORP	45	59	248	27,291	公益事業
FLUOR CORP	19	17	55	6,046	資本財
FREEMONT-MCMORAN INC	149	149	169	18,592	素材
GENERAL MILLS INC	67	66	342	37,623	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	29	28	487	53,486	資本財
WW GRAINGER INC	5	5	148	16,245	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	943	972	985	108,145	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	16	18	266	29,257	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	16	16	164	18,097	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	23	23	40	4,458	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	21	21	52	5,755	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39	37	757	83,082	各種金融
HALLIBURTON CO	92	99	251	27,582	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	78	82	1,422	156,120	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	16	16	59	6,567	自動車・自動車部品
HP INC	194	174	332	36,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	41	40	212	23,344	保険
HERSHEY CO/THE	15	15	199	21,874	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	129	126	2,458	269,755	小売
HASBRO INC	11	13	134	14,751	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	30	27	342	37,628	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	96	101	1,376	151,069	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	48	41	190	20,935	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ILLINOIS TOOL WORKS	36	33	515	56,561	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	37	46	107	11,749	メディア・娯楽
IDEX CORP	7	8	138	15,173	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8	10	136	14,953	素材
JOHNSON & JOHNSON	296	299	4,168	457,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	10	10	132	14,552	運輸
KELLOGG CO	29	29	174	19,170	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	35	38	493	54,178	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	171	162	842	92,452	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	84	87	225	24,768	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	22	19	130	14,350	小売
ELI LILLY & CO	112	99	1,159	127,220	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	11	11	195	21,448	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	15	15	81	8,970	運輸
LENNAR CORP-A	30	34	178	19,605	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	88	90	960	105,405	小売
LEGGETT & PLATT INC	19	16	62	6,877	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	26	26	63	6,964	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	43	43	285	31,303	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	27	28	977	107,284	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	25	23	155	17,039	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	3	3	99	10,962	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	8	8	196	21,573	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33	32	425	46,685	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	88	86	1,723	189,116	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	27	27	599	65,787	各種金融
MEDTRONIC PLC	147	150	1,326	145,613	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	299	290	2,272	249,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	124	126	493	54,210	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	46	46	53	5,859	耐久消費財・アパレル
3M CO	65	65	1,145	125,732	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17	18	278	30,525	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	53	53	136	14,985	消費者サービス
MASCO CORP	34	34	131	14,480	資本財
MONSANTO CO	50	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	13	14	247	27,168	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	53	56	542	59,491	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	7	7	95	10,457	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	146	144	669	73,422	各種金融
MCKESSON CORP	24	21	279	30,645	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	98	94	454	49,910	保険
MANPOWERGROUP INC	6	6	57	6,320	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	17	19	363	39,944	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	29	30	616	67,652	運輸
BANK OF AMERICA CORP	1,095	1,042	3,084	338,455	銀行
NISOURCE INC	47	47	133	14,603	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	18	18	554	60,870	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	68	—	—	—	銀行
NEWMONT GOLDCORP CORP	70	91	276	30,386	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	109	—	—	—	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13	13	204	22,402	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	1	1	167	18,339	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	
NUCOR CORP	37	34	198	21,778	素材
NEWELL BRANDS INC	53	53	82	9,075	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	49	—	—	—	メディア・娯楽
NOBLE ENERGY INC	51	51	122	13,493	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	82	84	464	51,004	エネルギー
OMNICOM GROUP	26	26	207	22,758	メディア・娯楽
PEPSICO INC	155	157	2,021	221,843	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	9	9	95	10,464	素材
ALTRIA GROUP INC	207	210	1,095	120,181	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	16	14	134	14,781	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	280	278	2,955	324,284	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	54	51	684	75,067	銀行
PFIZER INC	658	646	2,631	288,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	44	46	475	52,210	保険
PULTEGROUP INC	19	29	93	10,279	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	12	14	255	28,084	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18	19	299	32,901	エネルギー
CITIGROUP INC	292	273	1,855	203,630	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	34	32	181	19,889	保険
PPG INDUSTRIES INC	28	27	304	33,391	素材
PENTAIR PLC	18	18	69	7,596	資本財
PRAXAIR INC	29	—	—	—	素材
P G & E CORP	55	—	—	—	公益事業
PPL CORP	84	80	251	27,560	公益事業
PROGRESSIVE CORP	67	65	481	52,813	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55	55	327	35,888	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20	18	235	25,843	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	33	31	572	62,879	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	26	26	220	24,202	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	142	117	176	19,361	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5	5	89	9,851	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	11	11	416	45,695	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	44	57	171	18,865	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	10	14	81	8,909	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	12	12	213	23,404	資本財
SCHLUMBERGER LTD	157	155	613	67,346	エネルギー
STRYKER CORP	35	37	703	77,181	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	137	135	621	68,248	各種金融
SEMPRA ENERGY	26	30	392	43,077	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9	9	418	45,959	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	18	16	231	25,434	資本財
SUNTRUST BANKS INC	52	50	319	35,064	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	32	30	436	47,884	保険
SOUTHERN CO/THE	110	115	618	67,851	公益事業
AT&T INC	678	813	2,491	273,432	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	35	32	148	16,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	43	42	274	30,134	各種金融
SYSCO CORP	57	54	406	44,633	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	13	19	83	9,130	素材
SCANA CORP	12	—	—	—	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	107	107	1,209	132,785	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	13	13	139	15,303	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	
TORCHMARK CORP	10	10	96	10,603	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	107	103	408	44,881	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45	44	1,209	132,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	28	26	137	15,143	資本財
UNION PACIFIC CORP	86	82	1,449	159,076	運輸
UNUM GROUP	24	24	88	9,718	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	81	91	1,258	138,141	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	107	107	2,587	283,930	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	177	171	897	98,455	銀行
MARATHON OIL CORP	90	90	137	15,120	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	78	77	783	85,970	運輸
VALERO ENERGY CORP	47	47	397	43,581	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9	9	124	13,637	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	41	38	191	21,035	メディア・娯楽
VF CORP	36	38	357	39,183	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	14	14	189	20,743	素材
WILLIAMS COS INC	87	133	366	40,273	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	92	90	481	52,837	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	30	35	279	30,701	公益事業
WALMART INC	162	162	1,655	181,677	食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	5	155	17,115	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	517	500	2,360	259,006	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	44	47	509	55,922	商業・専門サービス
WATERS CORP	8	8	189	20,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	7	7	103	11,320	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	32	25	83	9,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	54	58	335	36,815	公益事業
KEYCORP	102	119	205	22,592	銀行
CARMAX INC	20	20	162	17,840	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24	22	278	30,571	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	35	34	350	38,479	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	65	138	749	82,302	小売
CA INC	31	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	15	14	218	23,954	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	14	14	150	16,537	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	29	32	227	24,981	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	41	46	254	27,926	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	36	36	424	46,637	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	44	51	147	16,171	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	30	35	299	32,856	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	70	86	241	26,545	銀行
STERICYCLE INC	12	—	—	—	商業・専門サービス
INTEL CORP	516	510	2,357	258,741	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	546	503	2,685	294,677	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	10	10	225	24,697	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	13	12	263	28,929	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	46	48	1,209	132,693	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	122	109	447	49,161	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	33	33	317	34,801	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	31	31	249	27,387	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	71	71	138	15,233	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	
ROSS STORES INC	43	41	406	44,559	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	28	27	241	26,510	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	149	142	1,195	131,170	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	73	71	1,224	134,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	20	18	141	15,541	銀行
NORTHERN TRUST CORP	24	23	227	24,977	各種金融
MICROSOFT CORP	810	815	10,362	1,137,180	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	9	9	175	19,246	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	20	46	257	28,272	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	153	138	1,086	119,216	消費者サービス
ORACLE CORP	340	296	1,622	178,005	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	47	48	1,758	192,991	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8	8	317	34,867	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	75	81	374	41,098	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	20	20	167	18,383	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	16	16	113	12,498	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12	12	129	14,158	小売
LAM RESEARCH CORP	18	17	349	38,309	半導体・半導体製造装置
COPART INC	—	22	152	16,775	商業・専門サービス
WYNN RESORTS LTD	11	11	144	15,822	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	514	507	2,190	240,381	メディア・娯楽
XILINX INC	28	28	329	36,131	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	33	38	270	29,680	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	26	26	146	16,100	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	8	8	282	30,983	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	139	144	949	104,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	16	16	158	17,416	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	12	12	630	69,194	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	28	27	672	73,825	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	5	6	154	16,974	銀行
PAYCHEX INC	37	35	305	33,537	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	49	103	11,368	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	7	6	79	8,719	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	14	14	173	18,993	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6	7	108	11,855	運輸
AUTODESK INC	23	24	428	47,063	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	19	19	50	5,566	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	78	85	1,365	149,892	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	17	15	62	6,860	小売
ALPHABET INC-CL A	32	33	3,901	428,105	メディア・娯楽
EAST WEST BANCORP INC	13	13	70	7,688	銀行
UNITED THERAPEUTICS CORP	6	5	47	5,213	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	16	13	104	11,453	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	25	25	109	12,006	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	156	135	1,164	127,745	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	30	30	137	15,057	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	16	16	194	21,367	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	30	30	170	18,764	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	45	46	8,777	963,195	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	28	27	286	31,413	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	15	15	149	16,422	ヘルスケア機器・サービス
KLAR-TENCOR CORP	17	17	202	22,209	半導体・半導体製造装置

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	
STEEL DYNAMICS INC	30	27	89	9,841	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	30	30	149	16,389	各種金融
CERNER CORP	27	32	226	24,882	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	14	14	39	4,285	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	9	12	241	26,507	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	31	29	271	29,817	商業・専門サービス
EBAY INC	102	102	381	41,898	小売
IAC/INTERACTIVECORP	7	8	201	22,145	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	66	64	1,093	120,013	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	28	26	276	30,307	小売
BOOKING HOLDINGS INC	5	5	947	104,018	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	140	144	3,027	332,254	各種金融
BB&T CORP	82	87	435	47,800	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	117	111	537	58,992	各種金融
BORGWARNER INC	21	21	82	9,045	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	28	28	77	8,459	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	11	11	148	16,279	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	88	—	—	—	メディア・娯楽
AMERISOURCEBERGEN CORP	18	17	136	14,928	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	7	5	55	6,133	保険
AETNA INC	34	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	26	26	195	21,426	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	57	55	469	51,469	公益事業
AON PLC	26	27	490	53,774	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54	62	264	29,017	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	12	—	—	—	保険
HESS CORP	31	29	186	20,464	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	37	37	100	11,001	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	26	31	166	18,278	各種金融
RED HAT INC	20	19	364	39,987	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	5	6	90	9,896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	22	22	80	8,802	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	14	18	142	15,649	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	29	28	192	21,150	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	20	20	166	18,300	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	39	67	159	17,463	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	24	22	509	55,909	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	16	16	516	56,733	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	53	54	1,518	166,676	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	29	28	480	52,772	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108	108	155	17,079	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELGENE CORP	89	78	746	81,900	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	68	65	384	42,236	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	63	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	18	18	136	14,944	運輸
FASTENAL CO	32	32	215	23,670	資本財
FISERV INC	46	44	378	41,490	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	51	51	54	5,962	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEKTAR THERAPEUTICS	—	17	61	6,738	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	156	190	109	11,973	メディア・娯楽
APPLE INC	566	530	10,458	1,147,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16	16	157	17,287	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	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	116	116	159	17,457	銀行
ZIONS BANCORP NA	16	21	103	11,322	銀行
COSTAR GROUP INC	3	4	204	22,469	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	24	24	320	35,175	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	14	14	119	13,076	運輸
CENTURYLINK INC	108	108	118	12,955	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	19	17	88	9,669	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	52	59	132	14,544	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	46	45	307	33,755	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	30	30	145	15,948	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	14	14	78	8,619	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	6	7	118	13,031	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	39	39	97	10,711	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	19	19	387	42,530	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.38	0.38	125	13,722	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	31	—	—	—	エネルギー
COOPER COS INC/THE	5	5	166	18,284	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	26	—	—	—	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	33	33	318	34,977	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	6	19	118	12,951	保険
AGCO CORP	8	—	—	—	資本財
DISCOVERY INC - A	23	10	30	3,307	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	43	44	282	30,973	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	13	13	163	17,893	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	23	23	97	10,683	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	64	58	148	16,297	メディア・娯楽
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16	15	222	24,462	各種金融
ANDEAVOR	18	—	—	—	エネルギー
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	26	32	128	14,063	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	60	64	526	57,749	各種金融
NASDAQ INC	11	11	104	11,471	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	22	22	49	5,485	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	20	16	108	11,949	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B	36	36	108	11,854	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	8	8	65	7,151	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	32	37	180	19,783	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2	2	200	21,985	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	27	31	162	17,791	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC	58	51	62	6,892	小売
ARROW ELECTRONICS INC	4	11	81	8,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	17	16	280	30,836	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	15	15	121	13,353	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	30	30	61	6,745	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6	6	143	15,729	素材
RANGE RESOURCES CORP	33	—	—	—	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	9	12	85	9,401	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	7	7	89	9,859	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	22	27	128	14,119	公益事業
WYNDHAM DESTINATIONS INC	8	—	—	—	消費者サービス
HANESBRANDS INC	34	34	58	6,387	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	104	102	2,541	278,860	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	44	44	85	9,378	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	
LEIDOS HOLDINGS INC	18	16	123	13,559	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	12	12	61	6,785	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	11	11	98	10,838	資本財
AVNET INC	14	—	—	—	
IPG PHOTONICS CORP	3	3	59	6,476	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	31	42	100	11,041	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	26	26	57	6,354	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	5	5	254	27,976	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11	11	142	15,657	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15	14	255	28,050	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	48	41	71	7,820	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	39	38	348	38,279	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41	36	286	31,409	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	8	11	203	22,299	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	4	6	80	8,804	資本財
MERCADOLIBRE INC	4	4	272	29,874	小売
VMWARE INC-CLASS A	7	9	192	21,099	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	30	30	156	17,182	保険
SEATTLE GENETICS INC	14	14	95	10,518	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	6	6	217	23,880	小売
LKQ CORP	32	32	88	9,734	小売
HORMEL FOODS CORP	28	33	132	14,588	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	11	—	—	—	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	15	15	117	12,931	素材
HARRIS CORP	13	13	237	26,041	資本財
HUMANA INC	16	14	364	40,014	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	—	34	127	14,035	公益事業
INVESCO LTD	46	46	98	10,852	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18	18	155	17,024	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	17	15	80	8,834	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	17	17	177	19,487	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	18	22	248	27,222	エネルギー
MSCI INC	9	9	208	22,865	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13	12	52	5,722	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	20	20	121	13,365	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	169	173	1,469	161,232	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	200	196	3,163	347,153	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	20	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	48	48	124	13,708	エネルギー
FLOWSERVE CORP	19	16	80	8,833	資本財
HELMERICH & PAYNE	15	12	74	8,129	エネルギー
T-MOBILE US INC	35	37	284	31,272	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	39	39	105	11,583	メディア・娯楽
RESMED INC	14	14	165	18,180	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	9	9	147	16,141	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	25	25	214	23,563	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13	41	142	15,641	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	25	25	188	20,740	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8	10	101	11,109	運輸
PERRIGO CO PLC	13	13	68	7,561	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	14	14	114	12,527	素材
WABTEC CORP	7	16	117	12,944	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	
EVERSOURCE ENERGY	39	35	254	27,924	公益事業
INGREDION INC	7	7	63	6,979	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	34	37	528	57,971	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	12	16	98	10,763	素材
EATON VANCE CORP	16	16	63	7,016	各種金融
DELTA AIR LINES INC	18	18	104	11,463	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20	20	220	24,155	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	18	18	257	28,205	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	29	29	360	39,537	小売
FORTINET INC	20	16	139	15,283	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	10	8	71	7,797	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2	2	211	23,157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	17	9	50	5,524	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	—	2	20	2,209	運輸
GENERAL MOTORS CO	135	142	538	59,052	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	34	38	384	42,244	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	39	35	293	32,184	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4	4	95	10,504	資本財
HCA HEALTHCARE INC	28	31	386	42,465	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	15	17	74	8,191	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	50	78	414	45,512	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	10	14	145	15,915	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	15	81	8,990	資本財
DEXCOM INC	—	9	117	12,905	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	5	5	73	8,065	資本財
XYLEM INC	18	18	145	15,957	資本財
ABIOMED INC	—	4	119	13,098	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	15	13	66	7,267	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5	7	99	10,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	16	18	189	20,747	銀行
ALLEGHANY CORP	1	1	100	10,994	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	8	8	280	30,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	47	49	429	47,088	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	263	268	5,052	554,430	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	32	32	180	19,822	公益事業
ALBEMARLE CORP	12	12	91	10,082	素材
PVH CORP	7	7	95	10,429	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	232	222	438	48,149	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	39	39	96	10,632	商業・専門サービス
APTIV PLC	28	28	219	24,103	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16	16	81	8,983	資本財
SPLUNK INC	14	16	217	23,891	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	27	22	94	10,406	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	5	5	46	5,113	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	175	168	1,302	142,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	14	14	344	37,824	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	20	24	163	17,934	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13	13	114	12,580	各種金融
ZOETIS INC	56	53	551	60,470	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	52	52	62	6,872	メディア・娯楽
SPRINT CORP	111	111	68	7,563	電気通信サービス
SNAP-ON INC	5	5	97	10,729	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	
CAPRI HOLDINGS LTD	14	14	63	7,010	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	70	77	296	32,502	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10	8	120	13,221	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	32	34	405	44,517	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	14	16	336	36,942	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	20	19	548	60,154	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8	8	106	11,736	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10	9	259	28,467	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	8	11	112	12,336	資本財
ALPHABET INC-CL C	34	35	4,086	448,462	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	9	9	123	13,596	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11	11	37	4,110	運輸
VOYA FINANCIAL INC	16	16	91	10,036	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	4	26	2,925	素材
ANTERO RESOURCES CORP	15	—	—	—	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	15	18	243	26,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	48	48	143	15,769	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	32	31	285	31,318	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	12	12	65	7,196	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	9	16	177	19,512	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	—	20	178	19,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	14	12	123	13,602	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTRWE	11	13	137	15,122	メディア・娯楽
OWENS CORNING	10	10	54	6,033	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17	24	140	15,382	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	10	10	241	26,556	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	91	72	252	27,673	各種金融
QORVO INC	12	15	114	12,522	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18	21	176	19,400	保険
ACUITY BRANDS INC	3	3	56	6,238	資本財
JONES LANG LASALLE INC	6	5	73	8,113	不動産
ARAMARK	17	29	93	10,256	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	57	53	192	21,169	銀行
LEAR CORP	6	6	97	10,733	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9	9	66	7,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	32	25	65	7,173	素材
TARGA RESOURCES CORP	21	26	107	11,801	エネルギー
GRUBHUB INC	—	10	67	7,374	小売
CHEMOURS CO/THE	17	17	48	5,303	素材
WESTROCK CO	27	27	100	11,043	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	66	66	217	23,837	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	123	125	1,380	151,515	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	7	96	10,546	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	16	16	59	6,486	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	162	162	239	26,335	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	0.88	0.88	34	3,789	運輸
CDW CORP/DE	16	16	172	18,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	28	28	58	6,407	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	41	61	156	17,220	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	6	5	155	17,049	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	17	17	83	9,148	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	14	22	146	16,042	商業・専門サービス

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	
GODADDY INC - CLASS A	—	19	150	16,543	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	9	—	—	—	素材
WAYFAIR INC- CLASS A	—	6	92	10,155	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	30	19	37	4,110	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13	13	53	5,859	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	14	14	56	6,185	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-LIBERTY-C	17	22	88	9,688	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	3	4	109	12,054	消費者サービス
DOMINO'S PIZZA INC	4	4	134	14,724	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	19	17	675	74,147	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	9	9	228	25,048	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	13	13	69	7,605	資本財
UGI CORP	16	19	109	11,977	公益事業
WESTAR ENERGY INC	13	—	—	—	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20	24	136	14,962	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	30	32	266	29,289	資本財
IHS MARKIT LTD	47	44	250	27,457	商業・専門サービス
XL GROUP LTD	32	—	—	—	保険
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	24	24	143	15,792	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	23	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTY INC-CL A	49	49	58	6,391	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC	41	51	116	12,751	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	16	110	12,176	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	31	31	64	7,034	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6	6	95	10,506	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	4	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC	4	5	163	17,912	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	26	26	85	9,424	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR	—	4	53	5,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENVISION HEALTHCARE CORP	15	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	45	45	103	11,344	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15	13	199	21,856	ヘルスケア機器・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10	10	110	12,177	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	31	31	183	20,146	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	14	14	67	7,405	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10	7	74	8,227	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	17	17	32	3,590	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	18	18	80	8,804	資本財
ROLLINS INC	13	19	72	7,909	商業・専門サービス
TESARO INC	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XPO LOGISTICS INC	—	13	81	8,908	運輸
BAKER HUGHES A GE CO	44	53	120	13,192	エネルギー
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	11	11	46	5,147	保険
DOWDUPONT INC	256	256	807	88,645	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	17	17	56	6,159	運輸
SQUARE INC - A	26	34	226	24,824	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	37	37	92	10,139	公益事業
PTC INC	—	13	113	12,491	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	46	46	1,404	154,140	半導体・半導体製造装置
APERGY CORP	8	—	—	—	エネルギー
EVERGY INC	—	29	173	19,057	公益事業
ALTICE USA INC- A	—	34	84	9,297	メディア・娯楽

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
LINDE PLC	—	61	1,118	122,694	素材	
WIX.COM LTD	—	5	71	7,866	ソフトウェア・サービス	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	28	63	6,972	各種金融	
BURLINGTON STORES INC	—	7	124	13,655	小売	
KKR & CO INC -A	—	50	122	13,471	各種金融	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	29	96	10,597	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CIGNA CORP	—	42	673	73,860	ヘルスケア機器・サービス	
DELL TECHNOLOGIES -C	—	18	123	13,583	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FOX CORP - CLASS A	—	36	140	15,454	メディア・娯楽	
FOX CORP - CLASS B	—	16	62	6,881	メディア・娯楽	
DOW INC	—	85	453	49,811	素材	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110	110	76	8,341	不動産	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22	22	82	9,099	資本財	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	25	25	160	17,643	資本財	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	—	20	15	1,722	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33,726	33,838	275,568	30,240,935	
		601	598	—	<60.8%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	158	161	1,697	138,632	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	29	29	110	8,989	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	30	23	199	16,298	商業・専門サービス	
TC ENERGY CORP	103	102	642	52,445	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	44	40	276	22,569	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	59	67	359	29,393	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	62	57	167	13,687	素材	
BARRICK GOLD CORP	127	193	310	25,364	素材	
BCE INC	13	13	77	6,349	電気通信サービス	
BOMBARDIER INC-B	274	274	58	4,767	資本財	
BANK OF MONTREAL	67	71	739	60,405	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	90	94	602	49,246	各種金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	136	137	990	80,938	銀行	
BAUSCH HEALTH COS INC	31	31	105	8,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	35	35	109	8,942	資本財	
CAMECO CORP	52	52	72	5,882	エネルギー	
CI FINANCIAL CORP	20	20	41	3,388	各種金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	48	48	531	43,428	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	130	137	520	42,477	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	85	81	1,005	82,092	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6	6	86	7,078	小売	
ENBRIDGE INC	188	226	1,116	91,209	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	3	185	15,116	保険	
CGI INC	22	27	259	21,228	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	25	45	61	5,001	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	11	11	40	3,299	各種金融	
LOBLAW COMPANIES LTD	24	20	135	11,103	食品・生活必需品小売り	
MANULIFE FINANCIAL CORP	216	216	514	41,990	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	42	34	215	17,620	自動車・自動車部品	
NATIONAL BANK OF CANADA	40	37	234	19,154	銀行	
ONEX CORPORATION	11	11	83	6,783	各種金融	
POWER CORP OF CANADA	33	42	125	10,243	保険	
POWER FINANCIAL CORP	21	30	93	7,650	保険	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	41	51	139	11,368	メディア・娯楽	

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	
SUNCOR ENERGY INC	190	180	769	62,867	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	7	9	92	7,543	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16	16	471	38,474	運輸
ENCANA CORP	104	165	146	11,927	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	23	28	151	12,393	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	27	23	52	4,264	資本財
GOLDCORP INC	87	—	—	—	素材
KINROSS GOLD CORP	176	133	54	4,432	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	23	23	62	5,104	資本財
GREAT-WEST LIFECO INC	28	28	89	7,311	保険
METHANEX CORP	12	5	32	2,683	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	161	161	29	2,419	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	10	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVWEAR INC	12	24	121	9,899	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	30	30	137	11,203	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	42	64	75	6,173	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	28	28	137	11,240	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70	70	87	7,118	素材
FORTIS INC	48	48	239	19,536	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	49	49	396	32,382	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	96	96	63	5,206	素材
TORONTO-DOMINION BANK	199	204	1,515	123,770	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	21	21	206	16,838	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	51	137	11,259	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	29	22	67	5,518	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	15	—	—	—	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	17	17	62	5,082	公益事業
METRO INC/CN	31	31	150	12,326	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	25	30	162	13,266	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	14	14	159	13,025	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	32	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	109	109	132	10,799	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	46	46	36	2,975	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	30	30	59	4,871	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	60	55	264	21,619	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	16	16	50	4,124	エネルギー
DOLLARAMA INC	11	33	132	10,795	小売
KEYERA CORP	28	28	87	7,147	エネルギー
ALTAGAS LTD	20	22	41	3,351	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	13	13	58	4,813	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	19	19	39	3,243	不動産
INTER PIPELINE LTD	48	48	99	8,135	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	15	15	28	2,348	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	33	33	29	2,398	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2	2	230	18,820	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	24	24	223	18,269	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9	9	54	4,426	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	12	18	100	8,224	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	59	—	—	—	各種金融
LINAMAR CORP	6	—	—	—	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD	43	43	94	7,695	公益事業
EMERA INC	7	7	35	2,877	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
SHOPIFY INC - CLASS A	8	10	347	28,365		ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	63	66	467	38,195		素材
WSP GLOBAL INC	—	11	77	6,292		資本財
AURORA CANNABIS INC	—	72	81	6,621		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANOPY GROWTH CORP	—	21	133	10,924		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARS GROUP INC/THE	—	20	52	4,322		消費者サービス
IA FINANCIAL CORP INC	—	15	76	6,260		保険
CRONOS GROUP INC	—	21	43	3,542		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,624	4,803	20,659	1,687,482	
		88	88	—	<3.4%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	118	118	89	11,028		銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	243	224	156	19,243		各種金融
SIEMENS AG-REG	82	85	914	112,723		資本財
RWE AG	56	56	125	15,525		公益事業
BASF SE	104	102	668	82,373		素材
VOLKSWAGEN AG	4	4	60	7,493		自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	109	101	547	67,462		自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21	20	175	21,688		家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	236	236	224	27,714		公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	38	36	248	30,625		自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	88	104	598	73,818		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG	48	47	943	116,261		保険
MAN SE	4	—	—	—		資本財
CONTINENTAL AG	12	12	167	20,587		自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	124	124	229	28,306		半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	16	16	97	11,984		自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22	22	42	5,184		運輸
HUGO BOSS AG -ORD	8	8	51	6,339		耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	100	110	317	39,082		運輸
SAP SE	106	109	1,209	149,104		ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	29	29	45	5,653		メディア・娯楽
DEUTSCHE BOERSE AG	19	21	253	31,247		各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	26	24	180	22,193		ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5	5	39	4,834		運輸
ADIDAS AG	21	20	506	62,366		耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	350	369	551	67,923		電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	16	16	347	42,804		保険
THYSSENKRUPP AG	47	47	68	8,464		素材
BEIERSDORF AG	10	10	104	12,831		家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	15	15	109	13,494		素材
MERCK KGAA	14	14	142	17,534		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	21	20	306	37,794		自動車・自動車部品
PUMA SE	—	0.72	39	4,911		耐久消費財・アパレル
LANXESS AG	11	11	54	6,673		素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	45	45	227	28,062		ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	3	3	35	4,368		資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	40	40	170	21,040		不動産
GEA GROUP AG	17	17	44	5,483		資本財
SYMRISE AG	12	14	120	14,871		素材
K+S AG-REG	24	—	—	—		素材
HENKEL AG & CO KGAA	11	11	92	11,357		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
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11	11	38	4,721	電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	7	7	44	5,465	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	5	6	87	10,803	保険	
BRENNTAG AG	14	14	66	8,252	資本財	
AXEL SPRINGER SE	7	7	37	4,656	メディア・娯楽	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	9	9	33	4,169	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	95	95	27	3,369	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	9	9	26	3,295	資本財	
VONOVIA SE	59	55	265	32,745	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	12	19	51	6,392	素材	
ZALANDO SE	15	15	61	7,531	小売	
COVESTRO AG	17	22	96	11,938	素材	
SCHAEFFLER AG - PREF	28	—	—	—	自動車・自動車部品	
UNIPER SE	28	28	74	9,174	公益事業	
INNOGY SE	21	12	50	6,212	公益事業	
METRO AG	22	22	31	3,928	食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	6	6	35	4,377	資本財	
LINDE AG - TENDER	19	—	—	—	素材	
I&I DRILLISCH AG	7	7	24	2,973	電気通信サービス	
MTU AERO ENGINES AG	5	5	118	14,629	資本財	
WIRECARD AG	12	12	167	20,684	ソフトウェア・サービス	
DELIVERY HERO SE	—	10	44	5,458	小売	
SARTORIUS AG-VORZUG	—	3	58	7,201	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17	17	61	7,605	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,728	2,686	11,813	1,456,045	
	銘柄 数 < 比 率 >	62	61	—	< 2.9% >	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	131	131	223	27,500	保険	
INTESA SANPAOLO	1,419	1,657	357	44,103	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	1,559	1,559	72	8,977	電気通信サービス	
ENI SPA	270	282	403	49,755	エネルギー	
UNICREDIT SPA	229	222	249	30,789	銀行	
ENEL SPA	920	904	502	61,876	公益事業	
RECORDATI SPA	14	14	49	6,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	51	51	118	14,597	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	106	—	—	—	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	17	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	48	71	65	8,036	銀行	
SNAM SPA	224	224	101	12,551	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RSP	360	360	15	1,941	電気通信サービス	
LEONARDO SPA	31	49	49	6,070	資本財	
TERNA SPA	132	132	73	9,046	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	108	—	—	—	保険	
PRYSMIAN SPA	27	27	45	5,586	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	86	65	60	7,447	食品・飲料・タバコ	
POSTE ITALIANE SPA	81	76	68	8,466	保険	
MONCLER SPA	—	18	68	8,406	耐久消費財・アパレル	
PIRELLI & C SPA	—	56	32	3,981	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,822	5,907	2,557	315,236	
	銘柄 数 < 比 率 >	19	18	—	< 0.6% >	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	16	18	207	25,612	自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	29	31	1,035	127,564	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	62	62	133	16,422	自動車・自動車部品
AXA SA	220	217	480	59,259	保険
DANONE	63	68	478	58,955	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	60	60	106	13,129	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	112	112	278	34,264	メディア・娯楽
INGENICO GROUP	8	8	57	7,121	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	88	85	224	27,628	銀行
AIR LIQUIDE SA	46	48	549	67,693	素材
TOTAL SA	269	270	1,267	156,196	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	55	55	187	23,137	資本財
VINCI SA	55	55	475	58,633	資本財
SANOFI	128	125	914	112,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	50	54	113	13,965	公益事業
L'OREAL	26	28	661	81,561	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	24	18	64	7,920	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	59	59	427	52,629	資本財
BNP PARIBAS	127	125	572	70,615	銀行
ESSILORLUXOTTICA	22	32	352	43,462	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE	19	17	187	23,096	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	7	7	25	3,081	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	28	28	82	10,148	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	3	3	221	27,303	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA	9	9	93	11,578	消費者サービス
KERING	8	8	427	52,750	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	14	14	198	24,453	ソフトウェア・サービス
ATOS SE	9	9	67	8,309	ソフトウェア・サービス
ORANGE	227	219	301	37,115	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	26	18	37	4,567	保険
IMERYS SA	5	5	20	2,524	素材
SAFRAN SA	37	37	455	56,144	資本財
RENAULT SA	23	21	120	14,843	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	22	22	112	13,891	メディア・娯楽
LAGARDERE SCA	18	—	—	—	メディア・娯楽
JCDECAUX SA	9	9	27	3,389	メディア・娯楽
SOCIETE BIC SA	4	4	32	3,972	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	22	22	72	8,875	資本財
THALES SA	10	12	123	15,210	資本財
PERNOD RICARD SA	23	23	354	43,750	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	116	132	153	18,935	銀行
ENGIE	207	203	267	32,948	公益事業
ALSTOM	9	19	75	9,346	資本財
ARKEMA	4	8	68	8,401	素材
LEGRAND SA	32	30	181	22,362	資本財
SCOR SE	14	18	66	8,152	保険
ADP	4	3	50	6,222	運輸
EDF	51	75	91	11,325	公益事業
NATIXIS	129	110	56	6,908	各種金融
WENDEL	4	3	38	4,693	各種金融
BUREAU VERITAS SA	22	22	48	5,939	商業・専門サービス
EURAZEO SE	5	5	39	4,839	各種金融
EURAZEO SE-NEW	—	0.29	1	234	各種金融

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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SUEZ	30	45	56	6,937	公益事業	
EIFFAGE	5	9	83	10,303	資本財	
ILIAD SA	2	2	22	2,802	電気通信サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	23	23	37	4,662	メディア・娯楽	
BIOMERIEUX	6	6	43	5,393	ヘルスケア機器・サービス	
GETLINK SE	66	51	72	8,994	運輸	
EDENRED	31	26	108	13,352	商業・専門サービス	
REMY COINTREAU	3	3	40	4,936	食品・飲料・タバコ	
REXEL SA	41	41	46	5,677	資本財	
BOLLORE	118	118	49	6,046	運輸	
DASSAULT AVIATION SA	0.33	0.33	42	5,197	資本財	
SEB SA	3	3	46	5,739	耐久消費財・アパレル	
IPSEN	4	4	49	6,058	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	4	4	27	3,405	各種金融	
FAURECIA	4	9	38	4,734	自動車・自動車部品	
TELEPERFORMANCE	5	6	106	13,146	商業・専門サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9	9	79	9,772	メディア・娯楽	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	—	3	45	5,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WORLDDLINE SA	—	9	47	5,824	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	3,025	3,049	13,730	1,692,296	
銘柄数<比率>		69	71	—	<3.4%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.	18	25	81	10,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CNH INDUSTRIAL NV	111	111	95	11,789	資本財	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	128	119	155	19,106	自動車・自動車部品	
FERRARI NV	12	14	177	21,931	自動車・自動車部品	
EXOR NV	14	14	80	9,943	各種金融	
AIRBUS SE	66	64	763	94,045	資本財	
STMICROELECTRONICS NV	71	71	106	13,101	半導体・半導体製造装置	
WOLTERS KLUWER	34	28	173	21,445	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE KPN NV	357	357	96	11,954	電気通信サービス	
AKZO NOBEL N.V.	26	25	194	23,911	素材	
HEINEKEN NV	25	28	276	34,040	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	96	105	390	48,141	ヘルスケア機器・サービス	
RELX NV	112	—	—	—	商業・専門サービス	
AEGON NV	178	216	92	11,426	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	138	131	270	33,337	食品・生活必需品小売り	
RANDSTAD NV	11	11	56	6,973	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	11	11	107	13,222	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	21	19	196	24,264	素材	
ING GROEP NV	444	435	455	56,105	銀行	
ASML HOLDING NV	44	45	802	98,922	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	185	172	914	112,729	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	9	9	34	4,231	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	12	—	—	—	資本財	
NN GROUP NV	33	33	125	15,522	保険	
ALTICE EUROPE NV	69	—	—	—	メディア・娯楽	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	45	45	88	10,894	銀行	
ADYEN NV	—	1	71	8,810	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	2,282	2,103	5,808	715,919	
銘柄数<比率>		26	24	—	<1.4%>	

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	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…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	40	26	39	4,819	資本財	
ENDESA SA	46	37	83	10,347	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22	25	95	11,766	資本財	
IBERDROLA SA	611	697	557	68,663	公益事業	
TELEFONICA SA	493	516	367	45,266	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	1,738	1,816	748	92,255	銀行	
BANKINTER SA	59	59	40	4,981	銀行	
REPSOL SA	143	159	228	28,126	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	753	743	377	46,537	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	32	40	104	12,876	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	126	121	307	37,839	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	73	—	—	—	運輸	
MAPFRE SA	144	144	37	4,670	保険	
FERROVIAL SA	37	61	126	15,553	資本財	
ENAGAS SA	32	25	65	8,039	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	41	41	78	9,730	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	523	707	73	9,083	銀行	
CAIXABANK SA	412	412	113	13,975	銀行	
GRIFOLS SA	28	28	66	8,139	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	50	48	323	39,909	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	90	—	—	—	運輸	
BANKIA SA	134	134	31	3,853	銀行	
AENA SME SA	7	7	121	15,024	運輸	
小 計	株数・金額	5,647	5,857	3,987	491,461	
	銘柄数<比率>	23	21	—	<1.0%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	18	18	83	10,316	保険	
UCB SA	16	14	98	12,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7	7	63	7,816	各種金融	
UMICORE	25	25	77	9,547	素材	
COLRUYT SA	8	8	54	6,709	食品・生活必需品小売り	
KBC GROUP NV	26	26	156	19,303	銀行	
SOLVAY SA	7	7	68	8,403	素材	
PROXIMUS	20	20	51	6,309	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	6	6	32	3,977	メディア・娯楽	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	86	85	630	77,703	食品・飲料・タバコ	
小 計	株数・金額	224	220	1,316	162,229	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	33	33	112	13,810	銀行	
VERBUND AG	—	9	42	5,250	公益事業	
OMV AG	14	14	64	7,921	エネルギー	
VOESTALPINE AG	9	9	23	2,940	素材	
ANDRITZ AG	9	9	35	4,346	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	20	20	47	5,800	銀行	
小 計	株数・金額	87	96	325	40,070	
	銘柄数<比率>	5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	6	6	28	3,569	メディア・娯楽	
AROUNDTOWN SA	—	89	67	8,270	不動産	
TENARIS SA	35	61	72	8,903	エネルギー	
SES	26	44	67	8,364	メディア・娯楽	

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…ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EUROFINS SCIENTIFIC	0.9	1	55	6,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	81	75	123	15,165	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	149	278	414	51,074	
		5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	647	627	272	33,574	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	52	52	55	6,899	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15	15	39	4,864	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	58	58	142	17,600	素材	
FORTUM OYJ	43	52	97	12,017	公益事業	
KONE OYJ-B	39	37	183	22,673	資本財	
METSO OYJ	17	12	39	4,881	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	47	47	186	23,019	保険	
WARTSILA OYJ ABP	57	57	77	9,609	資本財	
ELISA OYJ	19	19	75	9,260	電気通信サービス	
NESTE OYJ	11	42	122	15,057	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	13	13	39	4,914	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>	1,024	1,036	1,333	164,373	
		12	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	19	17	181	22,326	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	—	17	79	9,823	資本財	
PADDY POWER BETFAIR PLC	8	8	55	6,869	消費者サービス	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	59	115	61	7,538	銀行	
AIB GROUP PLC	124	92	37	4,590	銀行	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	—	24	63	7,792	素材	
CRH PLC	95	91	259	32,030	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	306	366	738	90,970	
		5	7	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	338	286	94	11,627	公益事業	
JERONIMO MARTINS	30	30	42	5,197	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	48	48	66	8,247	エネルギー	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	417	365	203	25,072	
		3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,715	21,969	42,229	5,204,750	
		239	239	—	<10.5%>	
(イギリス)						
BARCLAYS PLC	1,791	1,910	300	42,956	銀行	
BP PLC	2,174	2,243	1,176	167,900	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,170	7,943	484	69,237	銀行	
ASTRAZENECA PLC	135	141	804	114,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	37	47	71	10,241	資本財	
NEXT PLC	14	14	82	11,767	小売	
DIAGEO PLC	269	270	878	125,399	食品・飲料・タバコ	
SKY PLC	116	—	—	—	メディア・娯楽	
BAE SYSTEMS PLC	384	369	173	24,769	資本財	
UNILEVER PLC	132	123	571	81,577	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	1,110	1,086	263	37,558	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	101	218	380	54,269	商業・専門サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	142	199	54	7,724	小売	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	75	75	461	65,878	家庭用品・パーソナル用品	

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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
PRUDENTIAL PLC	295	289	466	66,650	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	687	687	186	26,612	保険
SAGE GROUP PLC/THE	113	113	80	11,545	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	2,197	2,240	1,460	208,571	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	249	256	727	103,933	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	95	78	62	8,990	公益事業
SCHRODERS PLC	17	17	53	7,689	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	392	527	122	17,532	銀行
BHP GROUP PLC	245	234	409	58,397	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	96	106	229	32,803	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	146	140	134	19,248	メディア・娯楽
CENTRICA PLC	562	690	63	9,128	公益事業
BT GROUP PLC	970	949	198	28,293	電気通信サービス
SSE PLC	112	112	124	17,835	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	380	308	209	29,979	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	201	187	172	24,629	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	14,324	13,333	1	190	資本財
COMPASS GROUP PLC	175	175	299	42,753	消費者サービス
KINGFISHER PLC	213	213	51	7,398	小売
PEARSON PLC	77	77	62	8,869	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	36	22	44	6,306	公益事業
RIO TINTO PLC	130	128	568	81,143	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	528	553	831	118,746	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	101	101	105	15,115	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	3,011	2,976	413	59,062	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	186	256	55	7,874	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	223	223	47	6,761	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	444	444	184	26,336	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	26	22	70	10,120	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	95	95	53	7,587	保険
WHITBREAD PLC	17	20	94	13,513	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	355	381	319	45,554	公益事業
FERGUSON PLC	29	—	—	—	資本財
BUNZL PLC	32	39	83	11,895	資本財
COBHAM PLC	311	—	—	—	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	145	118	223	31,901	素材
INTERTEK GROUP PLC	21	18	95	13,577	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	44	44	84	12,106	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	18	17	83	11,916	消費者サービス
CARNIVAL PLC	19	19	77	10,999	消費者サービス
PERSIMMON PLC	32	32	67	9,622	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	106	84	45	6,446	資本財
ITV PLC	331	446	53	7,608	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	36	34	173	24,794	各種金融
G4S PLC	234	184	38	5,531	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	19	14	53	7,659	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98	98	59	8,428	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	32	—	—	—	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	100	100	161	23,055	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	323	323	57	8,177	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	496	504	1,223	174,615	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	33	—	—	—	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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	410	418	1,019	145,498	エネルギー	
OLD MUTUAL PLC	552	—	—	—	保険	
INVESTEC PLC	88	88	42	6,014	各種金融	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	286	250	66	9,521	各種金融	
EXPERIAN PLC	108	101	221	31,581	商業・専門サービス	
MONDI PLC	35	35	59	8,476	素材	
WEIR GROUP PLC/THE	30	30	48	6,941	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	38	38	96	13,803	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	53	53	44	6,362	素材	
SHIRE PLC	97	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADMIRAL GROUP PLC	26	26	55	7,894	保険	
FRESNILLO PLC	29	29	21	3,083	素材	
RANDGOLD RESOURCES LTD	8	—	—	—	素材	
BABCOCK INTL GROUP PLC	44	44	23	3,283	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	48	48	53	7,582	各種金融	
GLENCORE PLC	1,288	1,256	352	50,383	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	22	37	87	12,424	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	12	15	76	10,930	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	552	552	100	14,382	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	26	26	71	10,172	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	19	19	20	2,937	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	193	154	48	6,898	保険	
ROYAL MAIL PLC	118	118	28	4,133	運輸	
ASHTAD GROUP PLC	54	54	110	15,765	資本財	
MERLIN ENTERTAINMENT	112	112	41	5,950	消費者サービス	
TUI AG-DI	42	42	35	5,064	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	49	41	73	10,497	ソフトウェア・サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	58	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
NMC HEALTH PLC	—	11	29	4,255	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	130	99	56	8,128	メディア・娯楽	
DCC PLC	8	11	76	10,885	資本財	
GVC HOLDINGS PLC	62	62	37	5,286	消費者サービス	
CONVATEC GROUP PLC	186	186	27	3,896	ヘルスケア機器・サービス	
JOHN WOOD GROUP PLC	52	64	28	4,096	エネルギー	
INFORMA PLC	—	137	103	14,744	メディア・娯楽	
FERGUSON PLC	—	24	132	18,948	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	48,691	46,887	19,482	2,781,491	
	銘柄 数 < 比 率 >	99	93	—	< 5.6% >	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	343	342	3,340	362,547	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	55	58	416	45,180	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	282	282	350	37,997	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	49	54	281	30,547	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	77	78	2,027	220,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	1	1	258	28,058	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	4	6	124	13,495	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	15	16	537	58,320	保険	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.99	0.99	81	8,822	ヘルスケア機器・サービス	
LONZA GROUP AG-REG	9	8	266	28,871	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	7	7	41	4,482	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5	5	108	11,769	資本財	
GEBERIT AG-REG	4	4	190	20,699	資本財	

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		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
SWISS RE AG	36	34	311	33,758	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3	3	91	9,952	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	6	2	18	1,968	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	243	242	1,991	216,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	17	17	96	10,509	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	2	2	131	14,245	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	193	206	399	43,384	資本財	
CLARIANT AG-REG	19	19	38	4,128	素材	
SGS SA-REG	0.55	0.55	139	15,160	商業・専門サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1	1	24	2,652	資本財	
TEMENOS AG - REG	—	6	111	12,060	ソフトウェア・サービス	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	5	5	70	7,683	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	4	5	93	10,110	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3	3	172	18,725	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	75	8,182	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	24	24	110	12,015	各種金融	
SIKA AG-REG	0.25	13	215	23,346	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	9	10	86	9,400	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.16	0.13	85	9,318	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1	1	130	14,190	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.31	0.31	56	6,152	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	1	64	6,984	素材	
UBS GROUP AG-REG	417	432	525	57,015	各種金融	
DUFREY AG-REG	2	2	25	2,806	小売	
VIFOR PHARMA AG	6	4	56	6,094	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALCON INC	—	48	304	33,077	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,857	1,958	13,452	1,459,915	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	39	—	< 2.9% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	22	22	509	5,807	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	296	343	3,037	34,622	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	44	44	1,127	12,848	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	182	182	1,631	18,602	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	53	50	2,174	24,788	各種金融	
NORDEA BANK AB	328	—	—	—	銀行	
GETINGE AB-B SHS	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	178	169	1,718	19,593	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	72	72	2,010	22,916	資本財	
SKF AB-B SHARES	36	36	587	6,696	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	120	112	2,204	25,135	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	116	97	1,556	17,740	小売	
SANDVIK AB	135	127	2,075	23,666	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	80	103	1,516	17,288	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	42	42	695	7,923	商業・専門サービス	
SKANSKA AB-B SHS	49	30	495	5,646	資本財	
SWEDISH MATCH AB	24	20	958	10,924	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	49	49	623	7,111	電気通信サービス	
TELIA CO AB	274	318	1,288	14,684	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	168	168	2,356	26,859	資本財	
ALFA LAVAL AB	26	35	746	8,515	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	24	24	686	7,826	エネルギー	
BOLIDEN AB	25	25	608	6,938	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	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	
HUSQVARNA AB-B SHS	56	56	482	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7	7	406	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS	27	27	1,341	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B	20	28	751	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25	25	519	各種金融
ICA GRUPPEN AB	12	12	452	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS	5	11	347	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	70	70	1,982	家庭用品・パーソナル用品
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	44	—	—	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	72	—	—	資本財
EPIROC AB-B	—	44	397	資本財
EPIROC AB-A	—	72	673	資本財
NORDEA BANK ABP	—	328	2,422	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,726 33	2,764 32	38,386 — <0.9%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ	
DNB ASA	117	108	1,680	銀行
NORSK HYDRO ASA	128	128	424	素材
ORKLA ASA	110	97	731	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	117	131	2,411	エネルギー
TELENOR ASA	83	83	1,443	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	16	16	600	素材
MOWI ASA	38	46	929	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21	21	364	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	13	13	286	メディア・娯楽
AKER BP ASA	—	13	349	エネルギー
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	647 9	662 10	9,222 — <0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ	
NOVO NORDISK A/S-B	213	202	6,477	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	24	24	793	素材
DANSKE BANK A/S	81	81	917	銀行
DEMANT A/S	16	16	356	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S	8	8	235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	23	21	1,227	資本財
CARLSBERG AS-B	11	11	977	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	11	11	858	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	20	20	1,235	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.92	0.82	666	運輸
TRYG A/S	14	14	298	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	0.3	228	運輸
PANDORA A/S	11	11	308	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	23	23	499	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	9	9	682	素材
GENMAB A/S	6	7	788	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S	19	21	1,137	公益事業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	497 17	487 17	17,690 — <0.6%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル	
BHP GROUP LTD	369	329	1,212	素材
CSL LTD	51	50	997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	328	328	73	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	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	104	104	372	28,563	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	330	321	883	67,720	銀行
RIO TINTO LTD	49	42	404	30,968	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	141	141	178	13,711	保険
LENLELEASE GROUP	74	74	94	7,262	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	195	198	1,496	114,684	銀行
WESTPAC BANKING CORP	382	385	1,049	80,410	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	301	307	797	61,102	銀行
BRAMBLES LTD	168	168	206	15,815	商業・専門サービス
BORAL LTD	172	150	72	5,538	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	142	142	469	35,994	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	462	462	157	12,090	電気通信サービス
AMP LTD	303	303	67	5,153	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	233	233	107	8,249	消費者サービス
AMCOR LIMITED	131	131	211	16,165	素材
COMPUTERSHARE LTD	65	52	94	7,269	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	54	66	173	13,291	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	38	36	448	34,391	各種金融
CIMIC GROUP LTD	13	13	61	4,744	資本財
ASX LTD	25	17	134	10,269	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	74	74	65	5,037	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	5	6	135	10,346	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	63	41	75	5,798	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	102	108	43	3,299	小売
NEWCREST MINING LTD	85	85	217	16,655	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	244	238	189	14,485	保険
ORIGIN ENERGY LTD	176	176	132	10,160	エネルギー
ORICA LTD	56	53	105	8,046	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	34	56	147	11,335	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	168	209	146	11,230	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	143	143	196	15,016	保険
TRANSURBAN GROUP	251	295	401	30,737	運輸
WESFARMERS LTD	133	126	463	35,532	小売
BLUESCOPE STEEL LTD	46	67	89	6,869	素材
CHALLENGER LTD	81	81	65	5,036	各種金融
SYDNEY AIRPORT	169	146	112	8,641	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	22	22	59	4,563	エネルギー
OIL SEARCH LTD	131	131	99	7,608	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	—	40	56	4,310	エネルギー
AGL ENERGY LTD	70	70	162	12,479	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	221	180	136	10,449	素材
AUSNET SERVICES	268	268	49	3,820	公益事業
CROWN RESORTS LTD	64	23	31	2,417	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	224	224	73	5,635	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	66	66	69	5,361	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	177	177	88	6,770	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	73	73	111	8,548	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12	17	107	8,268	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	9	9	38	2,949	消費者サービス
SEEK LTD	51	39	80	6,131	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	54	54	48	3,744	銀行
REA GROUP LTD	8	8	68	5,218	メディア・娯楽

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)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円
TPG TELECOM LTD	63	63	40	3,104	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	211	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	408	331	95	7,306	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	11	11	44	3,434	消費者サービス
SOUTH32 LTD	556	556	183	14,023	素材
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	—	19	44	3,404	エネルギー
COLES GROUP LTD	—	117	149	11,470	食品・生活必需品小売り
小 計	株数・金額	8,689	8,487	14,196	1,087,629
	銘柄数<比率>	59	61	—	<2.2%>
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル	
SPARK NEW ZEALAND LTD	241	241	87	6,318	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61	135	114	8,252	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	77	60	96	6,990	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	74	74	38	2,753	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	50	50	59	4,263	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	36	95	39	2,889	公益事業
MERCURY NZ LTD	127	—	—	—	公益事業
A2 MILK CO LTD	—	81	129	9,385	食品・飲料・タバコ
小 計	株数・金額	669	739	565	40,853
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>
(香港)				千香港ドル	
WHARF HOLDINGS LTD	170	170	383	5,359	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	70	55	531	7,427	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	318	298	2,379	33,259	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	160	175	2,345	32,783	不動産
MTR CORP	145	180	831	11,625	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	984	1,012	1,895	26,498	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	580	728	10,184	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	140	140	780	10,911	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	128	134	3,376	47,207	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD	140	140	303	4,237	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD	140	220	375	5,253	不動産
CLP HOLDINGS LTD	185	185	1,619	22,643	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	164	173	826	11,553	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	170	170	411	5,752	銀行
HANG SENG BANK LTD	93	85	1,725	24,122	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	100	100	426	5,962	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	200	200	211	2,952	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	34	34	295	4,132	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	230	390	507	7,098	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	95	95	235	3,293	耐久消費財・アパレル
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50	90	564	7,888	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	380	380	1,252	17,504	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	135	135	706	9,870	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	530	530	253	3,541	電気通信サービス
LI & FUNG LTD	720	—	—	—	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	95	95	305	4,276	不動産
MINTH GROUP LTD	100	100	242	3,383	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD	200	200	324	4,540	資本財
SANDS CHINA LTD	268	268	1,110	15,529	消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD	110	80	436	6,100	不動産
WYNN MACAU LTD	216	216	425	5,942	消費者サービス

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
SJM HOLDINGS LTD	280	280	266	3,718		消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	240	—	—	—		各種金融
AIA GROUP LTD	1,382	1,346	10,492	146,679		保険
SWIRE PROPERTIES LTD	154	154	488	6,835		不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	280	260	1,413	19,755		消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	112	112	160	2,239		消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	510	470	581	8,134		電気通信サービス
WH GROUP LTD	855	1,050	808	11,302		食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	273	273	1,695	23,709		不動産
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	600	—	—	—		各種金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	170	140	815	11,400		不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	11,907	10,717	42,533	594,613	
	銘柄 数 < 比 率 >	42	39	—	< 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	342	342	389	31,322		銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	207	207	49	3,978		メディア・娯楽
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123	123	31	2,502		資本財
CAPITALAND LTD	209	289	98	7,901		不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	68	59	51	4,146		不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	12	12	41	3,358		小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	201	199	528	42,484		銀行
KEPPEL CORP LTD	134	134	87	7,036		資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	146	146	373	30,065		銀行
VENTURE CORP LTD	—	32	51	4,124		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING	223	223	89	7,208		資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	841	841	266	21,437		電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	84	60	57	4,602		運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	113	110	81	6,527		各種金融
UOL GROUP LTD	75	75	54	4,378		不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	282	282	72	5,827		運輸
STARHUB LTD	127	—	—	—		電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,292	1,292	36	2,910		食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	202	202	70	5,701		食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD	897	656	61	4,932		消費者サービス
SATS LTD	125	30	15	1,271		運輸
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	291	291	43	3,486		資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	5,994	5,605	2,551	205,203	
	銘柄 数 < 比 率 >	21	21	—	< 0.4% >	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	93	93	184	5,685		素材
BANK HAPOALIM BM	89	119	325	10,026		銀行
NICE LTD	8	6	317	9,795		ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	124	182	447	13,779		銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	2	2	145	4,473		資本財
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	255	255	66	2,045		電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16	16	132	4,069		銀行
AZRIELI GROUP LTD	7	4	85	2,624		不動産
FRUTAROM	5	—	—	—		素材
小 計	株 数 ・ 金 額	604	681	1,703	52,498	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 0.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	142,351	139,603	—	44,200,969	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,261	1,252	—	< 88.9% >	

(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	4	4	147	16,239	0.0
MACERICH CO/THE	1	1	44	4,893	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.997	1	186	20,456	0.0
PROLOGIS INC	5	6	523	57,454	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.849	1	106	11,691	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2	2	110	12,166	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	2	270	29,664	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.75	0.75	212	23,361	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	1	134	14,814	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.692	0.847	109	12,023	0.0
WELLTOWER INC	4	4	323	35,538	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	1	1	226	24,809	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	1	132	14,536	0.0
REALTY INCOME CORP	3	3	228	25,042	0.1
REGENCY CENTERS CORP	1	1	101	11,119	0.0
SL GREEN REALTY CORP	0.748	0.832	70	7,719	0.0
UDR INC	2	2	121	13,311	0.0
VENTAS INC	3	4	254	27,889	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	12	16	154	16,984	0.0
WEYERHAEUSER CO	8	8	209	22,957	0.0
AMERICAN TOWER CORP	4	4	963	105,705	0.2
AGNC INVESTMENT CORP	5	5	91	10,034	0.0
WP CAREY INC	—	1	135	14,849	0.0
VEREIT INC	13	11	94	10,349	0.0
DUKE REALTY CORP	3	4	123	13,534	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4	—	—	—	—
IRON MOUNTAIN INC	2	3	98	10,768	0.0
EQUINIX INC	0.899	0.897	430	47,231	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	4	4	582	63,885	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	3	3	302	33,244	0.1
COLONY CAPITAL INC	7	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	2	3	89	9,855	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	1	33	3,684	0.0
GGP INC	6	—	—	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	7	7	151	16,590	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	2	98	10,810	0.0
PUBLIC STORAGE	1	1	396	43,506	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	3	3	606	66,584	0.1
VORNADO REALTY TRUST	1	1	124	13,695	0.0
KIMCO REALTY CORP	3	5	94	10,371	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	1	308	33,853	0.1
小 計	口 数	口 数	金 額	金 額	比 率
	143	135	8,394	921,229	
銘 柄 数 < 比 率 >	39	38	—	< 1.9% >	

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	%
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		0.9	0.9	30	2,481	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		1	1	37	3,039	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		2	2	51	4,242	0.0
小 計		4	4	119	9,763	
		銘柄数 < 比率 >	3	3	—	< 0.0% >
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		0.418	0.418	56	6,903	0.0
KLEPIERRE		2	2	63	7,874	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		1	—	—	—	—
COVIVIO		0.467	0.467	45	5,611	0.0
ICADE		0.44	0.44	33	4,078	0.0
小 計		4	3	198	24,467	
		銘柄数 < 比率 >	5	4	—	< 0.0% >
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	1	221	27,340	0.1
小 計		—	1	221	27,340	
		銘柄数 < 比率 >	—	1	—	< 0.1% >
ユ ー ロ 計		4	4	420	51,808	
		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		9	9	52	7,515	0.0
HAMMERSON PLC		10	10	32	4,707	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		7	7	64	9,147	0.0
SEGRO PLC		13	13	92	13,207	0.0
小 計		41	40	242	34,578	
		銘柄数 < 比率 >	4	4	—	< 0.1% >
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		29	29	73	5,602	0.0
SCENTRE GROUP		61	61	227	17,459	0.0
GPT GROUP		15	15	91	7,022	0.0
MIRVAC GROUP		56	39	114	8,792	0.0
STOCKLAND		22	22	85	6,525	0.0
WESTFIELD CORP		21	—	—	—	—
DEXUS		13	11	142	10,934	0.0
GOODMAN GROUP		18	18	250	19,154	0.0
小 計		238	198	985	75,492	
		銘柄数 < 比率 >	8	7	—	< 0.2% >
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		22	22	2,098	29,331	0.1
小 計		22	22	2,098	29,331	
		銘柄数 < 比率 >	1	1	—	< 0.1% >
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		32	32	57	4,634	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		39	27	51	4,155	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		32	32	78	6,337	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	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	36	27	79	6,406	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	140	267	21,534	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	595	—	1,143,738	
	銘柄 数 < 比 率 >	64	—	< 2.3% >	

(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) 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	百万円	百万円
株式先物取引		
SP EMINI	2,328	—
SP/TSE60	127	—
SWISS IX	112	—
EURO ST	455	—
SPI 200	156	—
FTSE100	215	—

(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

(2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	44,200,969	88.8
投資証券	1,143,738	2.3
コール・ローン等、その他	4,406,718	8.9
投資信託財産総額	49,751,425	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(46,794,913千円)の投資信託財産総額(49,751,425千円)に対する比率は94.1%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=109.74円	1 カナダドル=81.68円	1 ユーロ=123.25円	1 イギリスポンド=142.77円
1 スイスフラン=108.52円	1 スウェーデンクローネ=11.40円	1 ノルウェークローネ=12.57円	1 デンマーククローネ=16.51円
1 オーストラリアドル=76.61円	1 ニュージーランドドル=72.25円	1 香港ドル=13.98円	1 シンガポールドル=80.41円
1 イスラエルシェケル=30.82円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	97,325,261,437
コール・ローン等	2,647,325,832
株式(評価額)	44,200,969,398
投資証券(評価額)	1,143,738,470
未収入金	48,573,756,719
未収配当金	75,326,981
差入委託証拠金	684,144,037
(B) 負債	47,584,809,613
未払金	47,582,012,636
未払解約金	2,795,180
未払利息	1,797
(C) 純資産総額(A-B)	49,740,451,824
元本	27,637,491,756
次期繰越損益金	22,102,960,068
(D) 受益権総口数	27,637,491,756口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,997円

<注記事項>

- ①期首元本額 27,311,888,003円
 期中追加設定元本額 6,797,727,331円
 期中一部解約元本額 6,472,123,578円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7997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)	62,276,247円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	1,665,928,179円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	1,690,925,628円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	41,339,008円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	28,823,482円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,664,763,817円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,521,523,311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)	19,961,333,782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)	578,302円
合計	27,637,491,756円

○損益の状況 (2018年5月15日～2019年5月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,023,902,835
受取配当金	1,007,889,390
受取利息	10,720,357
その他収益金	8,195,864
支払利息	△ 2,902,776
(B) 有価証券売買損益	183,938,481
売買益	8,255,507,222
売買損	△ 8,071,568,741
(C) 先物取引等取引損益	143,231,017
取引益	482,998,239
取引損	△ 339,767,222
(D) 保管費用等	△ 15,287,540
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,335,784,793
(F) 前期繰越損益金	20,372,944,415
(G) 追加信託差損益金	5,177,716,985
(H) 解約差損益金	△ 4,783,486,125
(I) 計(E+F+G+H)	22,102,960,068
次期繰越損益金(I)	22,102,960,068

(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。