

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コクサイ・インデックス（配当込み、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コクサイ・インデックス（配当込み、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3期（決算日：2020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3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

お客さま専用 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 (分配落)	税込み		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	金額	期中騰落率	(配当込み、 円ヘッジ・円ベース)				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2017年8月16日	10,000	—	—	638.50	—	—	—	—	1
1期(2018年6月25日)	10,939	0	9.4	699.01	9.5	89.8	9.2	2.1	27
2期(2019年6月25日)	11,484	0	5.0	734.55	5.1	91.7	5.6	2.5	128
3期(2020年6月25日)	11,524	0	0.3	738.34	0.5	89.0	8.8	2.2	289

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、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コクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 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		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、 円ヘッジ・円ベース)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2019年6月25日	円	%		%	%	%	%
	11,484	—	734.55	—	91.7	5.6	2.5
6月末	11,429	△ 0.5	730.57	△ 0.5	91.4	6.4	2.4
7月末	11,693	1.8	747.99	1.8	92.9	4.9	2.5
8月末	11,352	△ 1.1	725.93	△ 1.2	89.4	5.9	2.5
9月末	11,546	0.5	738.56	0.5	89.2	9.6	2.5
10月末	11,807	2.8	755.05	2.8	90.4	8.6	2.5
11月末	12,181	6.1	779.44	6.1	92.8	5.1	2.6
12月末	12,461	8.5	796.83	8.5	93.7	4.4	2.5
2020年1月末	12,548	9.3	802.58	9.3	90.6	6.3	2.5
2月末	11,533	0.4	737.22	0.4	91.8	7.1	2.6
3月末	9,924	△13.6	634.59	△13.6	91.3	5.0	2.5
4月末	11,041	△ 3.9	706.93	△ 3.8	88.5	7.8	2.3
5月末	11,405	△ 0.7	730.52	△ 0.5	88.7	8.5	2.3
(期 末) 2020年6月25日	円	%		%	%	%	%
	11,524	0.3	738.34	0.5	89.0	8.8	2.2

(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3期：2019年6月26日～2020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3期首	11,484円
第3期末	11,524円
既払分配金	0円
騰落率	0.3%

※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0.3%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（0.5%）を0.2%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第3期：2019年6月26日～2020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。

全世界的な経済活動再開への期待などを
受けて、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

▶ 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コクサイ・
インデックス（配当込み、円ヘッジ・円
ベース）に採用されている株式等（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 $\Delta 0.2\%$ 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 $\Delta 0.3\%$ 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 0.1% 程度でした。

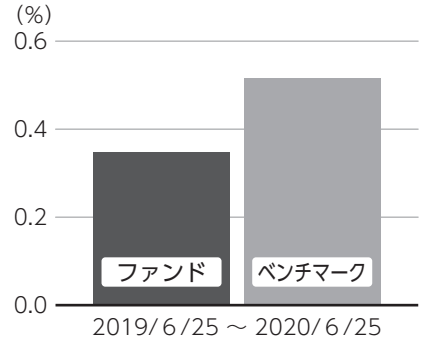
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

*その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

主なマイナス要因：組入要因によるものです。

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3期 2019年6月26日～2020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	1,524

（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。

2019年6月26日～2020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	25	0.218	(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)	(0.098)	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)	(0.098)	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）	(3)	(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	0.012	(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）	(1)	(0.009)	
（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	2	0.019	(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）	(2)	(0.019)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	5	0.046	(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）	(5)	(0.042)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	33	0.295	

期中の平均基準価額は、11,538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。

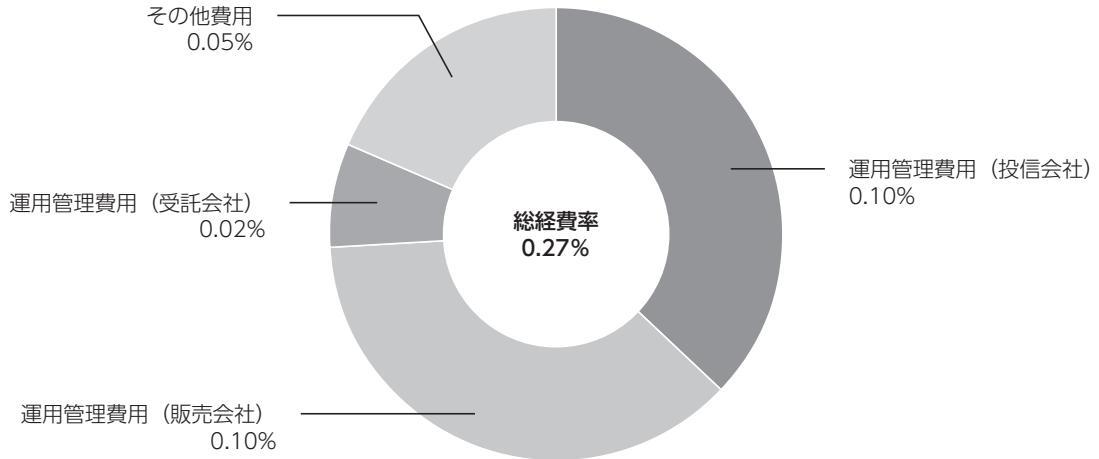
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.27%**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

(2019年6月26日～2020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 89,067	千円 163,215	千口 2,649	千円 4,948

○株式売買比率

(2019年6月26日～2020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	47,556,560千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	45,710,510千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.04

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年6月26日～2020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	百万円 616,327	百万円 485,202	% 78.7	百万円 590,407	百万円 463,378	% 78.5
為替直物取引	9,189	8,576	93.3	38,004	28,588	75.2

平均保有割合 0.4%

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

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

(2020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 69,984	千口 156,402	千円 289,830

○投資信託財産の構成

(2020年6月25日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	%
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	千円 289,830	99.8
コール・ローン等、その他	647	0.2
投資信託財産総額	290,477	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（20,400,648千円）の投資信託財産総額（54,679,441千円）に対する比率は37.3%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=107.06円	1 カナダドル=78.58円	1 ユーロ=120.52円	1 イギリスポンド=133.04円
1 スイスフラン=112.92円	1 スウェーデンクローネ=11.44円	1 ノルウェークローネ=11.08円	1 デンマーククローネ=16.17円
1 オーストラリアドル=73.56円	1 ニュージーランドドル=68.70円	1 香港ドル=13.81円	1 シンガポールドル=76.91円
1 イスラエルシェケル=31.09円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年6月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	290,477,587
コール・ローン等	647,194
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	289,830,393
(B) 負債	612,120
未払解約金	352,751
未払信託報酬	255,464
その他未払費用	3,905
(C) 純資産総額(A-B)	289,865,467
元本	251,526,216
次期繰越損益金	38,339,251
(D) 受益権総口数	251,526,216口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,524円

<注記事項>

- ①期首元本額 112,300,071円
 期中追加設定元本額 176,292,521円
 期中一部解約元本額 37,066,376円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1524円です。

○損益の状況（2019年6月26日～2020年6月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 90
受取利息	1
支払利息	△ 91
(B) 有価証券売買損益	1,684,325
売買益	3,462,487
売買損	△ 1,778,162
(C) 信託報酬等	△ 440,121
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,244,114
(E) 前期繰越損益金	5,830,325
(F) 追加信託差損益金	31,264,812
(配当等相当額)	(16,469,507)
(売買損益相当額)	(14,795,305)
(G) 計(D+E+F)	38,339,251
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	38,339,251
追加信託差損益金	31,264,812
(配当等相当額)	(16,773,807)
(売買損益相当額)	(14,491,005)
分配準備積立金	9,846,592
繰越損益金	△ 2,772,153

- (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	2019年6月26日～ 2020年6月25日
費用控除後の配当等収益額	4,016,267円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	28,492,659円
分配準備積立金額	5,830,325円
当ファンドの分配対象収益額	38,339,251円
1万口当たり収益分配対象額	1,524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】

株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2019年7月1日)

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

《第13期》決算日2020年5月12日

[計算期間：2019年5月14日～2020年5月12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12日に第13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13期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、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コクサイ・インデックス（配当込み、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コクサイ・インデックス（配当込み、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コクサイ・インデックス (配当込み、円ヘッジ・円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資 産額
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
9期(2016年5月12日)	13,282	△ 4.6	532.25	△ 4.8	88.4	10.2	2.5	87,141
10期(2017年5月12日)	15,753	18.6	629.71	18.3	94.3	4.8	2.4	85,648
11期(2018年5月14日)	17,459	10.8	697.35	10.7	92.3	5.1	2.1	47,684
12期(2019年5月13日)	17,997	3.1	717.72	2.9	88.9	6.8	2.3	49,740
13期(2020年5月12日)	17,659	△ 1.9	703.98	△ 1.9	88.1	9.9	2.3	52,656

(注) MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、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コクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「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 コクサイ・インデックス (配当込み、円ヘッジ・円ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2019年5月13日	円	%		%	%	%	%
	17,997	—	717.72	—	88.9	6.8	2.3
5月末	17,573	△ 2.4	700.25	△ 2.4	92.6	2.2	2.5
6月末	18,338	1.9	730.57	1.8	91.4	6.4	2.4
7月末	18,764	4.3	747.99	4.2	92.9	4.9	2.5
8月末	18,220	1.2	725.93	1.1	89.4	5.9	2.6
9月末	18,536	3.0	738.56	2.9	89.2	9.6	2.5
10月末	18,958	5.3	755.05	5.2	90.4	8.6	2.5
11月末	19,562	8.7	779.44	8.6	92.8	5.1	2.6
12月末	20,016	11.2	796.83	11.0	93.7	4.4	2.5
2020年1月末	20,160	12.0	802.58	11.8	90.6	6.3	2.5
2月末	18,532	3.0	737.22	2.7	91.8	7.1	2.6
3月末	15,950	△11.4	634.59	△11.6	91.3	5.0	2.5
4月末	17,748	△ 1.4	706.93	△ 1.5	88.5	7.8	2.3
(期 末) 2020年5月12日	円	%		%	%	%	%
	17,659	△ 1.9	703.98	△ 1.9	88.1	9.9	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1.9%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−1.9%)とほぼ同程度となりました。

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。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 外国株式市況

外国株式市況は下落しました。

- ・ 外国株式市況は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などを受けて下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、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（R E I T）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1.9%の下落になったため、カイ離は0.0%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)

- ・ その他の要因によるものです。

※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・ 組入要因によるものです。
- ・ 為替ヘッジに係る要因※によるものです。

※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

(2019年5月14日～2020年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.009	(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)	(2)	(0.009)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	6	0.035	(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)	(6)	(0.034)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	9	0.048	
期中の平均基準価額は、18,478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

(2019年5月14日～2020年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 7,429 (800)	千アメリカドル 58,559 (2,319)	百株 4,138 (524)	千アメリカドル 30,474 (4,080)
	カナダ	973 (△ 69)	千カナダドル 4,613 (-)	1,023 (19)	千カナダドル 2,306 (39)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	562 (6)	2,420 (△ 27)	296	1,271
	イタリア	1,697	579	1,032	251
	フランス	597 (4)	2,809 (△ 1)	343	1,464
	オランダ	779	1,846	344	677
	スペイン	1,089 (1,833)	867 (38)	2,467	426
	ベルギー	55	371	34	149
	オーストリア	19 (-)	61 (△ 4)	6	34
	ルクセンブルク	88	75	43	59
	フィンランド	279 (4)	278 (-)	131	135
	アイルランド	25 (0.17)	106 (1)	11 (-)	36 (1)
	ポルトガル	80	58	10	15
	イギリス	6,790 (8,956)	千イギリスポンド 4,123 (△ 15)	3,343 (22,059)	千イギリスポンド 2,074 (59)
	スイス	440 (-)	千スイスフラン 2,922 (△ 29)	213	千スイスフラン 1,452
	スウェーデン	544 (80)	千スウェーデンクローネ 7,948 (150)	243 (54)	千スウェーデンクローネ 3,948 (161)
	ノルウェー	205	千ノルウェークローネ 1,880	95	千ノルウェークローネ 1,359
	デンマーク	86	千デンマーククローネ 4,264	62	千デンマーククローネ 2,172
	オーストラリア	2,008 (△ 1)	千オーストラリアドル 3,261 (△ 7)	1,001 (2)	千オーストラリアドル 1,655 (0.35728)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 185	千ニュージーランドドル 129	百株 32	千ニュージーランドドル 30
	香港	2,297 (118)	千香港ドル 8,140 (—)	1,515	千香港ドル 4,633
	シンガポール	650	千シンガポールドル 509	1,631	千シンガポールドル 298
	イスラエル	187 (7)	千イスラエルシェケル 414 (—)	315	千イスラエルシェケル 203

(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
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	66	0.963	31
MACERICH CO/THE	—	—	1	28
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.426	63	0.246	37
PROLOGIS INC	1 (1)	157 (79)	0.917	76
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.234	15	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.432	24	0.392	20
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.947	123	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1 (0.954)	132 (—)	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.147	46	0.123	37
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.617	66	0.279	31
WELLTOWER INC	1	132	0.72	59
BOSTON PROPERTIES INC	0.172	24	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	7	138	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.334	46	0.129	16
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2	105	—	—
REALTY INCOME CORP	1	66	0.23	17
REGENCY CENTERS CORP	1	58	0.323	21
SL GREEN REALTY CORP	0.26	22	0.197	17
SUN COMMUNITIES INC	1	152	—	—
UDR INC	1	89	1	46
VENTAS INC	0.773	45	0.304	20
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	—	— (16)	— (154)
WEYERHAEUSER CO	0.86	24	—	—
AMERICAN TOWER CORP	1	235	0.553	116
AGNC INVESTMENT CORP	1	22	1 (5)	17 (96)
WP CAREY INC	0.588	36	—	—
VEREIT INC	2	19	—	—
DUKE REALTY CORP	0.568	18	—	—
IRON MOUNTAIN INC	0.693	15	—	—
EQUINIX INC	0.227	125	0.072	38
CROWN CASTLE INTL CORP	0.818	113	0.323	43
EQUITY RESIDENTIAL	1	104	0.738	59
INVITATION HOMES INC	3	92	—	—
VICI PROPERTIES INC	5	129	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	1	32
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.164 (1)	41 (263)	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	1	20	—	—

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
LIBERTY PROPERTY TRUST	— (△ 1)	— (△ 79)	0.391	20
PUBLIC STORAGE	0.347	70	0.167	38
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.819	81	0.251	38
VORNADO REALTY TRUST	0.58	17	—	—
KIMCO REALTY CORP	1	22	1	20
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.333	61	0.105	22
小 計	50 (1)	2,833 (263)	13 (21)	911 (250)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.9	49	—	—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	— (1)	— (39)	—	—
小 計	0.9 (1)	49 (39)	—	—
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	0.131	19	—	—
COVIVIO	0.207	22	—	—
ICADE	—	—	0.168	15
小 計	0.338	42	0.168	15
オランダ				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.184	23	—	—
小 計	0.184	23	—	—
ユ ー ロ 計	0.522	65	0.168	15
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
HAMMERSON PLC	—	—	10	30
LAND SECURITIES GROUP PLC	1	17	1	13
SEGRO PLC	4	36	4	34
小 計	6	53	16	77
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	12	31	—	—
GPT GROUP	7	46	—	—
MIRVAC GROUP	10	33	7	25
STOCKLAND	6	31	—	—
DEXUS	5	60	2	25
GOODMAN GROUP	4	68	3	55
小 計	46	273	13	105
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	4	360	1	119
小 計	4	360	1	119
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	— (—)	— (△0.12231)	14	27

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
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	24 (-)	59 (△0.00729)	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	20 (-)	61 (△0.41012)	7	23
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	- (4)	- (-)	4	1
小計		44 (4)	120 (△0.53972)	26	52

(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 32,578	百万円 30,284	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

(2019年5月14日～2020年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	14,166,054千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	45,316,987千円
(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

(2019年5月14日～2020年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	%	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 581,972	百万円 458,279	78.7	百万円 584,701	百万円 457,770	78.3
為替直物取引	9,573	9,040	94.4	4,859	3,109	64.0

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

(2020年5月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO	81	86	736	79,214	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	196	219	2,104	226,256	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	35	38	316	34,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5	—	—	—	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	48	53	774	83,262	ソフトウェア・サービス
AES CORP	76	76	94	10,207	公益事業
AFLAC INC	86	93	330	35,556	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	99	111	307	33,090	保険
APACHE CORP	41	41	50	5,431	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	105	131	731	78,648	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5	5	22	2,433	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	71	78	1,475	158,668	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24	27	635	68,295	素材
ANTHEM INC	28	31	855	92,014	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	56	—	—	—	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	153	172	651	70,075	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	56	59	533	57,322	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	60	66	855	92,019	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	29	33	877	94,331	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	26	28	225	24,285	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	182	290	1,820	195,789	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	13	14	706	75,923	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	461	512	2,887	310,513	電気通信サービス
BALL CORP	35	39	252	27,145	素材
ALLSTATE CORP	37	40	414	44,565	保険
AVERY DENNISON CORP	10	10	117	12,611	素材
CHUBB LTD	51	55	568	61,072	保険
ANALOG DEVICES INC	41	45	494	53,169	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	2	2	303	32,634	小売
CVS HEALTH CORP	144	161	1,029	110,696	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	88	96	205	22,093	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	372	388	3,498	376,137	銀行
CATERPILLAR INC	65	68	745	80,179	資本財
COCA-COLA CO/THE	452	503	2,294	246,757	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	53	59	352	37,911	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	22	21	109	11,782	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	89	91	604	64,984	運輸
CHEVRON CORP	213	234	2,188	235,297	エネルギー
TAPESTRY INC	29	38	53	5,744	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	128	138	583	62,755	エネルギー
CME GROUP INC	39	44	818	87,980	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	34	38	202	21,752	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	92	101	701	75,373	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	84	101	807	86,851	公益事業
DEVON ENERGY CORP	52	44	55	5,967	エネルギー
DEERE & CO	34	37	501	53,967	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	
DANAHER CORP	70	77	1,251	134,575	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	200	223	2,412	259,338	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	14	15	110	11,931	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	80	90	741	79,749	公益事業
DR HORTON INC	39	46	224	24,127	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	55	62	755	81,239	小売
DAVITA INC	16	10	85	9,141	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	16	19	174	18,757	資本財
DTE ENERGY COMPANY	20	24	242	26,103	公益事業
EXXON MOBIL CORP	473	524	2,398	257,878	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23	25	580	62,453	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	64	74	369	39,751	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	69	76	428	46,041	資本財
EXELON CORP	108	121	451	48,541	公益事業
ECOLAB INC	28	32	628	67,611	素材
EQUIFAX INC	13	14	218	23,477	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	24	27	470	50,561	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	48	51	418	45,035	資本財
EDISON INTERNATIONAL	37	45	259	27,949	公益事業
ENTERGY CORP	19	24	231	24,901	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	3	5	90	9,776	保険
NEXTERA ENERGY INC	53	60	1,378	148,178	公益事業
MACY'S INC	39	—	—	—	小売
FEDEX CORP	28	31	365	39,259	運輸
FORD MOTOR CO	410	499	255	27,489	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	35	35	68	7,410	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	4	127	13,697	各種金融
FIRSTENERGY CORP	59	68	277	29,843	公益事業
FLUOR CORP	17	—	—	—	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	149	176	158	16,996	素材
GENERAL MILLS INC	66	75	461	49,586	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	28	30	406	43,737	資本財
WW GRAINGER INC	5	5	161	17,409	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	972	1,084	671	72,178	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	18	37	643	69,220	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	16	16	127	13,660	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	23	—	—	—	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	21	21	16	1,775	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	37	39	723	77,749	各種金融
HALLIBURTON CO	99	100	106	11,465	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	82	88	1,186	127,586	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	16	16	33	3,602	自動車・自動車部品
HP INC	174	176	272	29,314	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	40	47	164	17,651	保険
HERSHEY CO/THE	15	17	235	25,301	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	126	135	3,202	344,363	小売
HASBRO INC	13	16	112	12,111	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	27	30	246	26,504	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	101	109	1,345	144,686	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	41	47	157	16,928	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	33	39	645	69,416	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	46	50	84	9,044	メディア・娯楽

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	
IDEX CORP	8	9	145	15,668	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10	12	168	18,139	素材
JOHNSON & JOHNSON	299	326	4,864	523,005	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	10	12	169	18,238	運輸
KELLOGG CO	29	30	195	21,071	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	38	42	588	63,320	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	162	177	903	97,188	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	87	96	324	34,877	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	19	19	34	3,677	小売
ELI LILLY & CO	99	107	1,698	182,661	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	200	21,588	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	15	15	40	4,348	運輸
LENNAR CORP-A	34	34	183	19,699	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	90	95	1,082	116,442	小売
LEGGETT & PLATT INC	16	16	46	4,989	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	26	—	—	—	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	43	41	200	21,588	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	28	31	1,182	127,171	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	23	24	87	9,437	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	3	4	75	8,129	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	8	—	—	—	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	32	35	294	31,682	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	86	93	1,697	182,560	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	27	30	910	97,924	各種金融
MEDTRONIC PLC	150	165	1,637	176,032	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	290	315	2,458	264,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	126	137	662	71,232	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	46	—	—	—	耐久消費財・アパレル
3M CO	65	71	1,039	111,734	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18	21	278	29,972	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	53	61	90	9,696	消費者サービス
MASCO CORP	34	35	149	16,029	資本財
M & T BANK CORP	14	15	150	16,224	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	56	62	647	69,567	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	7	7	56	6,123	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	144	150	599	64,503	各種金融
MCKESSON CORP	21	20	285	30,674	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	94	99	337	36,254	保険
MANPOWERGROUP INC	6	6	42	4,619	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	19	21	532	57,247	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	30	32	563	60,636	運輸
BANK OF AMERICA CORP	1,042	1,059	2,393	257,305	銀行
NISOURCE INC	47	48	113	12,196	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	18	19	649	69,820	資本財
NEWMONT CORP	91	101	640	68,854	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13	14	246	26,462	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	1	1	156	16,803	保険
NUCOR CORP	34	37	153	16,486	素材
NEWELL BRANDS INC	53	57	68	7,396	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	51	51	48	5,261	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	84	105	158	17,010	エネルギー
OMNICOM GROUP	26	26	143	15,433	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PEPSICO INC	157	172	2,320	249,540	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	9	12	118	12,758	素材
ALTRIA GROUP INC	210	231	843	90,664	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	14	14	106	11,434	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	278	309	3,565	383,412	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51	54	555	59,741	銀行
PFIZER INC	646	686	2,614	281,131	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	46	51	291	31,301	保険
PULTEGROUP INC	29	29	87	9,394	耐久消費財・アパレル
PARKER HANFIFIN CORP	14	16	266	28,693	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19	19	168	18,148	エネルギー
CITIGROUP INC	273	270	1,194	128,401	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	32	33	123	13,296	保険
PPG INDUSTRIES INC	27	30	273	29,447	素材
PENTAIR PLC	18	18	62	6,762	資本財
PPL CORP	80	87	221	23,820	公益事業
PROGRESSIVE CORP	65	72	528	56,785	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55	63	308	33,131	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18	21	83	8,964	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	31	—	—	—	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	26	26	217	23,351	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	117	130	128	13,766	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5	6	97	10,533	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	11	12	467	50,307	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	57	58	106	11,438	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	14	14	65	7,023	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	12	14	274	29,480	資本財
SCHLUMBERGER LTD	155	178	310	33,340	エネルギー
STRYKER CORP	37	41	807	86,840	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	135	143	515	55,421	各種金融
SEMPRA ENERGY	30	35	440	47,340	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9	10	576	61,949	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	16	18	205	22,128	資本財
SUNTRUST BANKS INC	50	—	—	—	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	30	32	312	33,580	保険
SOUTHERN CO/THE	115	130	727	78,171	公益事業
AT&T INC	813	905	2,658	285,887	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	32	36	152	16,444	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	42	43	257	27,647	各種金融
SYSCO CORP	54	62	324	34,836	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	19	19	56	6,052	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	107	115	1,329	142,985	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	13	13	171	18,440	小売
TERADYNE INC	—	22	144	15,538	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	10	13	102	11,015	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	103	93	268	28,816	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	44	49	1,692	181,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	26	26	69	7,440	資本財
UNION PACIFIC CORP	82	86	1,350	145,203	運輸
UNUM GROUP	24	24	36	3,895	保険
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	91	187	1,076	115,779	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	107	117	3,390	364,595	ヘルスケア機器・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	
US BANCORP	171	184	614	66,043	銀行
MARATHON OIL CORP	90	90	51	5,582	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	77	86	816	87,774	運輸
VALERO ENERGY CORP	47	53	352	37,880	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9	11	139	14,979	ヘルスケア機器・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	38	65	118	12,764	メディア・娯楽
VF CORP	38	43	246	26,491	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	14	16	158	17,040	素材
WILLIAMS COS INC	133	144	281	30,319	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	90	93	391	42,128	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	35	39	337	36,235	公益事業
WALMART INC	162	176	2,177	234,080	食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC	5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	500	498	1,234	132,782	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	47	52	527	56,741	商業・専門サービス
WATERS CORP	8	7	146	15,774	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	7	8	89	9,592	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	25	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	58	65	395	42,476	公益事業
KEYCORP	119	120	128	13,821	銀行
CARMAX INC	20	19	146	15,730	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22	24	292	31,487	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	34	38	334	35,920	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	138	150	728	78,306	小売
CLOROX COMPANY	14	15	326	35,140	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	14	15	123	13,273	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	32	34	283	30,449	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	46	46	64	6,973	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	36	76	976	104,957	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	51	60	201	21,711	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	35	40	292	31,412	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	86	82	141	15,209	銀行
INTEL CORP	510	539	3,243	348,770	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	503	524	2,273	244,453	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	10	11	242	26,069	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	12	—	—	—	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	48	54	1,696	182,415	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	109	114	619	66,625	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	33	36	428	46,124	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	31	35	216	23,244	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC	71	77	165	17,841	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	41	45	416	44,757	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27	30	267	28,757	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	142	154	1,405	151,100	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP	—	18	152	16,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	71	73	1,788	192,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	18	16	54	5,878	銀行
NORTHERN TRUST CORP	23	26	194	20,942	各種金融
MICROSOFT CORP	815	898	16,784	1,804,716	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	9	10	287	30,899	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	46	72	489	52,583	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	138	147	1,117	120,111	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	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	
ORACLE CORP	296	284	1,525	163,987	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	48	54	2,394	257,474	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8	9	385	41,431	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	81	95	718	77,305	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	20	20	228	24,537	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	16	16	91	9,858	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12	15	164	17,721	小売
LAM RESEARCH CORP	17	18	472	50,750	半導体・半導体製造装置
COPART INC	22	25	209	22,488	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	9	113	12,174	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	11	11	91	9,866	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	507	562	2,034	218,769	メディア・娯楽
XILINX INC	28	31	268	28,842	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	38	42	295	31,741	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	26	28	113	12,252	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	8	9	211	22,741	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	144	156	1,267	136,230	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	249	26,811	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	12	14	771	82,946	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	27	32	928	99,840	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6	6	112	12,082	銀行
PAYCHEX INC	35	38	256	27,598	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	49	49	77	8,314	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	6	6	63	6,870	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	14	15	165	17,753	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7	11	172	18,538	運輸
AUTODESK INC	24	27	502	54,067	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	19	23	50	5,386	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	85	103	1,887	202,966	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	15	11	19	2,098	小売
ALPHABET INC-CL A	33	37	5,214	560,645	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	6	147	15,885	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EAST WEST BANCORP INC	13	19	64	6,900	銀行
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	4	246	26,499	各種金融
UNITED THERAPEUTICS CORP	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	13	16	137	14,739	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	25	35	131	14,172	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	135	141	1,139	122,512	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	30	36	191	20,537	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSIS INC	16	18	292	31,497	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	30	34	185	19,989	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	46	52	12,591	1,353,874	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	27	29	329	35,422	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	15	17	193	20,777	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	17	19	324	34,915	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	27	23	57	6,132	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	30	25	106	11,998	各種金融
CERNER CORP	32	37	259	27,940	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	14	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	12	12	273	29,448	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	29	31	296	31,925	商業・専門サービス
EBAY INC	102	93	395	42,562	小売

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	
IAC/INTERACTIVECORP	8	10	246	26,514	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	64	72	2,326	250,170	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	26	29	228	24,602	小売
BOOKING HOLDINGS INC	5	5	733	78,889	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	144	162	2,843	305,750	各種金融
TRUIST FINANCIAL CORP	87	166	574	61,748	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	111	105	364	39,222	各種金融
BORGWARNER INC	21	30	89	9,611	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	28	—	—	—	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	11	14	168	18,099	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	17	19	178	19,179	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	5	7	78	8,442	保険
AMEREN CORPORATION	26	29	208	22,450	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	55	61	484	52,053	公益事業
AON PLC	27	—	—	—	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	62	67	239	25,789	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	29	34	160	17,300	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	37	37	90	9,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	31	31	115	12,399	各種金融
RED HAT INC	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	6	8	119	12,866	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	22	28	75	8,082	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	18	20	208	22,425	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	28	29	129	13,930	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	20	23	232	24,948	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	67	77	205	22,070	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	22	22	734	78,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	16	18	585	62,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	54	60	2,228	239,650	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28	31	908	97,694	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	136	156	16,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELGENE CORP	78	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65	69	383	41,247	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	18	21	163	17,598	運輸
FASTENAL CO	32	71	283	30,491	資本財
FISERV INC	44	71	728	78,316	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	51	51	51	5,512	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEKTAR THERAPEUTICS	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	190	202	114	12,331	メディア・娯楽
APPLE INC	530	551	17,358	1,866,365	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16	18	102	10,989	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	116	139	114	12,364	銀行
ZIONS BANCORP NA	21	21	62	6,689	銀行
COSTAR GROUP INC	4	4	306	32,973	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	24	27	273	29,441	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	17	129	13,887	運輸
CENTURYLINK INC	108	125	121	13,086	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	17	19	94	10,111	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	59	59	101	10,894	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	45	49	153	16,539	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	30	30	152	16,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	14	20	71	7,667	食品・飲料・タバコ

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	
ADVANCE AUTO PARTS INC	7	8	101	10,941	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	39	40	52	5,662	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	19	21	344	37,082	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.38	0.46	140	15,113	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	5	6	184	19,891	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	33	37	325	35,043	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	19	19	99	10,748	保険
DISCOVERY INC - A	10	24	49	5,268	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	44	51	342	36,831	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	13	16	108	11,676	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	23	31	87	9,424	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	58	50	106	11,399	メディア・娯楽
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15	16	202	21,789	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	32	34	86	9,335	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	64	68	648	69,750	各種金融
NASDAQ INC	11	13	148	15,926	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	22	22	20	2,222	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	16	16	67	7,270	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B	36	—	—	—	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	8	8	52	5,678	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	37	42	171	18,468	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2	3	291	31,329	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	31	36	246	26,498	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC-SERIES A	51	—	—	—	小売
ARROW ELECTRONICS INC	11	8	55	5,940	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	—	26	101	10,931	保険
CUMMINS INC	16	17	283	30,533	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	15	15	121	13,068	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	30	30	42	4,564	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6	7	132	14,209	素材
CIMAREX ENERGY CO	12	—	—	—	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	7	5	36	3,962	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	27	30	145	15,667	公益事業
HANESBRANDS INC	34	51	46	4,971	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	102	111	3,130	336,577	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	44	53	102	11,014	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	16	16	171	18,448	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	12	16	47	5,070	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	11	11	22	2,398	資本財
IPG PHOTONICS CORP	3	5	82	8,861	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	42	42	47	5,078	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	26	26	42	4,567	消費者サービス
HEICO CORP	—	5	53	5,771	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	5	6	221	23,862	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11	14	171	18,490	ソフトウェア・サービス
INSULET CORP	—	8	184	19,861	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14	15	316	33,997	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	41	54	63	6,823	銀行
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	82	435	46,874	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	38	42	319	34,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	36	42	172	18,575	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	11	13	323	34,754	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WABCO HOLDINGS INC	6	6	81	8,810	資本財
MERCADOLIBRE INC	4	5	424	45,603	小売
VMWARE INC-CLASS A	9	10	144	15,491	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	30	35	107	11,516	保険
SEATTLE GENETICS INC	14	15	248	26,669	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	146	15,703	小売
LKQ CORP	32	39	100	10,854	小売
HORMEL FOODS CORP	33	37	177	19,077	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	25	102	11,067	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO	15	15	95	10,320	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	13	27	490	52,755	資本財
HUMANA INC	14	16	628	67,626	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	34	28	92	9,910	公益事業
INVESCO LTD	46	46	36	3,896	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18	21	208	22,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	15	15	78	8,489	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	17	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	22	25	142	15,268	エネルギー
MSCI INC	9	10	351	37,784	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	12	12	17	1,872	エネルギー
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	20	25	97	10,454	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	173	192	1,375	147,854	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	196	212	3,896	418,904	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	48	48	93	10,011	エネルギー
FLOWERVE CORP	16	16	40	4,350	資本財
HELMERICH & PAYNE	12	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	37	51	501	53,878	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	39	41	75	8,160	メディア・娯楽
RESMED INC	14	18	307	33,034	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	9	11	132	14,289	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	25	27	229	24,692	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41	48	122	13,177	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	25	29	220	23,738	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	10	11	114	12,361	運輸
PERRIGO CO PLC	13	17	92	9,898	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	14	17	159	17,098	素材
WABTEC CORP	16	24	136	14,684	資本財
EVERSOURCE ENERGY	35	40	310	33,340	公益事業
INGREDION INC	7	7	60	6,557	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	37	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	16	16	98	10,538	素材
EATON VANCE CORP	16	11	43	4,704	各種金融
DELTA AIR LINES INC	18	18	40	4,366	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20	21	260	27,956	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	18	19	315	33,919	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	29	31	583	62,780	小売
FORTINET INC	16	19	267	28,815	ソフトウェア・サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	8	9	22	2,443	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2	2	210	22,585	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	9	—	—	—	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	2	—	—	—	運輸
GENERAL MOTORS CO	142	160	367	39,463	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	
NXP SEMICONDUCTORS NV	38	35	363	39,058	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	35	34	195	21,024	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4	5	100	10,800	資本財
HCA HEALTHCARE INC	31	34	360	38,742	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	17	17	51	5,521	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	78	77	252	27,184	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	14	14	143	15,421	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	15	82	8,817	資本財
DEXCOM INC	9	10	460	49,472	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	5	7	46	5,002	資本財
XYLEM INC	18	22	137	14,817	資本財
ABIOMED INC	4	5	115	12,408	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	13	14	24	2,637	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7	7	85	9,145	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	18	20	209	22,566	銀行
ALLEGHANY CORP	1	1	91	9,872	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	8	10	576	61,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	49	56	434	46,749	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	268	298	6,363	684,195	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	32	35	196	21,140	公益事業
ALBEMARLE CORP	12	12	81	8,760	素材
PVH CORP	7	7	34	3,725	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	222	255	393	42,275	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	39	39	54	5,905	商業・専門サービス
APTIV PLC	28	31	208	22,421	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16	16	60	6,463	資本財
SPLUNK INC	16	19	310	33,361	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A	—	8	62	6,735	資本財
OGC ENERGY CORP	22	22	69	7,497	公益事業
POLARIS INC	5	5	41	4,459	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	168	218	1,921	206,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	4	165	17,846	資本財
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	8	113	12,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	14	16	1,361	146,371	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	24	31	139	15,006	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13	15	104	11,251	各種金融
ZOETIS INC	53	59	746	80,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	9	201	21,679	ヘルスケア機器・サービス
NEWS CORP - CLASS A	52	55	59	6,381	メディア・娯楽
SPRINT CORP	111	—	—	—	電気通信サービス
SNAP-ON INC	5	7	92	9,973	資本財
PERKINELMER INC	—	14	133	14,369	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAPRI HOLDINGS LTD	14	14	21	2,297	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	77	94	281	30,294	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8	8	166	17,950	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	34	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	16	19	328	35,284	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	19	23	897	96,525	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8	8	85	9,221	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9	11	261	28,095	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	11	11	117	12,605	資本財
ALPHABET INC-CL C	35	38	5,382	578,769	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
UNITED RENTALS INC	9	8	101	10,924	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11	11	11	1,196	運輸
VOYA FINANCIAL INC	16	16	72	7,828	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4	4	18	2,000	素材
IQVIA HOLDINGS INC	18	19	273	29,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	48	49	74	8,054	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	31	32	219	23,550	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	12	12	50	5,474	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	16	16	68	7,356	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	20	23	237	25,483	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	12	14	179	19,262	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	13	14	189	20,371	メディア・娯楽
OWENS CORNING	10	16	70	7,566	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	24	24	28	3,053	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	10	12	280	30,132	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	72	67	119	12,808	各種金融
QORVO INC	15	14	150	16,226	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	17	97	10,431	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21	23	207	22,311	保険
ACUITY BRANDS INC	3	3	32	3,443	資本財
JONES LANG LASALLE INC	5	6	67	7,290	不動産
ARAMARK	29	29	71	7,723	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	53	59	126	13,583	銀行
LEAR CORP	6	6	72	7,778	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9	14	203	21,914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	25	25	49	5,313	素材
TARGA RESOURCES CORP	26	26	35	3,826	エネルギー
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	4	48	5,207	ソフトウェア・サービス
GRUBHUB INC	10	10	47	5,076	小売
CHEMOURS CO/THE	17	—	—	—	素材
WESTROCK CO	27	32	85	9,211	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	66	81	239	25,736	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	125	138	1,991	214,099	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	—	7	169	18,192	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	6	182	19,641	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	7	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	16	17	95	10,257	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	162	169	164	17,710	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	0.88	0.88	25	2,788	運輸
CDW CORP/DE	16	18	192	20,676	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	28	28	18	2,041	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	61	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	5	6	154	16,661	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	17	22	131	14,138	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	22	22	179	19,250	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	19	19	146	15,701	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	—	6	51	5,561	メディア・娯楽
WAYFAIR INC- CLASS A	6	6	121	13,031	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	19	19	15	1,675	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13	19	62	6,717	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	14	9	31	3,385	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22	22	68	7,368	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
VAIL RESORTS INC	4	5	94	10,113	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	2	119	12,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	4	4	186	20,009	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17	18	950	102,251	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	9	10	305	32,808	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	13	18	81	8,735	資本財
UGI CORP	19	24	74	8,028	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	24	29	112	12,145	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	32	36	213	22,906	資本財
IHS MARKIT LTD	44	48	325	34,944	商業・専門サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	24	28	162	17,499	ソフトウェア・サービス
COTY INC-CL A	49	31	14	1,605	家庭用品・パーソナル用品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	9	91	9,844	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC	51	43	51	5,499	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	16	16	98	10,552	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	31	—	—	—	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6	8	74	7,963	保険
TELEFLEX INC	5	5	194	20,957	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	26	—	—	—	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR	4	5	84	9,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECHNIPFMC PLC	45	45	33	3,651	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	13	16	334	36,001	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A	—	14	262	28,230	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10	12	127	13,692	各種金融
SNAP INC - A	—	88	159	17,139	メディア・娯楽
DXC TECHNOLOGY CO	31	27	45	4,932	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	14	17	47	5,096	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7	10	63	6,831	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	17	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	18	18	54	5,819	資本財
ROLLINS INC	19	19	81	8,813	商業・専門サービス
XPO LOGISTICS INC	13	9	65	7,026	運輸
BAKER HUGHES CO	53	78	115	12,377	エネルギー
OKTA INC	—	13	231	24,854	ソフトウェア・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	11	—	—	—	保険
DUPONT DE NEMOURS INC	256	93	432	46,480	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	17	17	67	7,279	運輸
BLACK KNIGHT INC	—	16	124	13,410	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	34	41	308	33,163	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	37	52	96	10,355	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	—	44	129	13,899	資本財
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	5	170	18,331	ソフトウェア・サービス
PTC INC	13	13	93	10,094	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	46	49	1,354	145,626	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	29	29	165	17,752	公益事業
ALTICE USA INC- A	34	16	39	4,255	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	2	51	5,489	保険
DOCUSIGN INC	—	11	144	15,501	ソフトウェア・サービス
LINDE PLC	61	66	1,243	133,686	素材
WIX.COM LTD	5	7	119	12,855	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	28	46	80	8,659	各種金融
BURLINGTON STORES INC	7	9	158	17,077	小売

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		
KKR & CO INC -A	50	59	158	16,991		各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	29	48	99	10,750		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	42	46	875	94,123		ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	18	18	79	8,594		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MONGODB INC	—	5	99	10,701		ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	36	39	102	10,995		メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	16	23	60	6,515		メディア・娯楽
DOW INC	85	93	318	34,207		素材
DROPBOX INC-CLASS A	—	33	76	8,272		ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	—	10	160	17,215		ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	—	50	160	17,261		運輸
CORTEVA INC	—	88	216	23,324		素材
AMCOR PLC	—	193	171	18,387		素材
XEROX HOLDINGS CORP	—	22	40	4,328		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROKU INC	—	10	145	15,604		メディア・娯楽
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	18	134	14,425		ソフトウェア・サービス
PINTEREST INC- CLASS A	—	34	64	6,967		メディア・娯楽
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	8	245	26,436		ソフトウェア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	—	14	100	10,766		素材
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	194	117	12,627		各種金融
AGNC INVESTMENT CORP	—	67	83	8,992		各種金融
AON PLC	—	28	551	59,312		保険
OTIS WORLDWIDE CORP	—	50	262	28,254		資本財
CARRIER GLOBAL CORP	—	101	186	20,014		資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110	162	67	7,228		不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22	30	64	6,893		資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	25	29	127	13,738		資本財
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	20	28	13	1,463		食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33,838 598	37,406 609	309,975 —	33,328,609 <63.3%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	161	177	1,532	117,214		銀行
IMPERIAL OIL LTD	29	29	60	4,657		エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	23	26	251	19,199		商業・専門サービス
TC ENERGY CORP	102	116	763	58,412		エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	40	45	261	19,972		電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	67	74	356	27,292		保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	57	57	70	5,391		素材
BARRICK GOLD CORP	193	224	817	62,504		素材
BCE INC	13	18	102	7,863		電気通信サービス
BOMBARDIER INC-B	274	—	—	—		資本財
BANK OF MONTREAL	71	80	549	42,034		銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	94	165	779	59,605		各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	137	151	806	61,672		銀行
BAUSCH HEALTH COS INC	31	42	99	7,598		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	35	35	76	5,882		資本財
CAMECO CORP	52	52	77	5,948		エネルギー
CI FINANCIAL CORP	20	20	29	2,217		各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	48	56	467	35,770		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	137	163	373	28,556		エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	81	89	1,035	79,172		運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6	10	107	8,251		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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
ENBRIDGE INC	226	251	1,159	88,695	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	3	105	8,079	保険
CGI INC	27	31	278	21,273	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	45	45	18	1,402	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	11	11	32	2,483	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	20	24	172	13,157	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	216	249	426	32,617	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	34	36	196	15,028	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	37	41	230	17,629	銀行
ONEX CORPORATION	11	11	72	5,561	各種金融
POWER CORP OF CANADA	42	66	139	10,639	保険
POWER FINANCIAL CORP	30	—	—	—	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	51	65	151	11,556	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC	180	200	475	36,384	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	9	9	93	7,167	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16	17	547	41,892	運輸
ENCANA CORP	165	—	—	—	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	28	28	253	19,373	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	23	—	—	—	資本財
KINROSS GOLD CORP	133	133	128	9,834	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	23	—	—	—	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	28	37	78	6,032	保険
METHANEX CORP	5	5	10	815	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	161	—	—	—	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	24	24	47	3,606	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	30	31	112	8,576	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	64	64	41	3,151	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	28	56	129	9,926	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70	70	60	4,608	素材
FORTIS INC	48	54	293	22,410	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	49	108	446	34,108	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	96	65	39	3,056	素材
TORONTO-DOMINION BANK	204	224	1,296	99,127	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	21	23	455	34,833	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	51	58	346	26,509	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	22	22	69	5,324	食品・生活必需品小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	17	17	55	4,248	公益事業
METRO INC/CN	31	32	190	14,567	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	30	36	200	15,344	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	14	16	223	17,125	保険
CENOVUS ENERGY INC	109	137	70	5,384	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	46	—	—	—	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	30	—	—	—	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	55	63	211	16,202	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	16	—	—	—	エネルギー
DOLLARAMA INC	33	40	176	13,519	小売
KEYERA CORP	28	29	59	4,523	エネルギー
ALTAGAS LTD	22	40	66	5,056	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	13	7	26	2,042	公益事業
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	19	—	—	—	不動産
INTER PIPELINE LTD	48	48	55	4,254	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	15	15	14	1,119	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			
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	33	—	—	—	—	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2	2	296	22,683		ソフトウェア・サービス	
RESTAURANT BRANDS INTERN	24	33	249	19,056		消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9	4	15	1,215		素材	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	18	18	78	6,028		素材	
HYDRO ONE LTD	43	43	111	8,506		公益事業	
EMERA INC	7	28	155	11,909		公益事業	
SHOPIFY INC - CLASS A	10	13	1,365	104,383		ソフトウェア・サービス	
NUTRIEN LTD	66	68	333	25,535		素材	
WSP GLOBAL INC	11	15	133	10,239		資本財	
AURORA CANNABIS INC	72	6	6	479		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CANOPY GROWTH CORP	21	21	44	3,365		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	23	86	6,593		消費者サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	15	14	57	4,411		保険	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	38	218	16,720		素材	
CRONOS GROUP INC	21	21	15	1,185		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
QUEBECOR INC -CL B	—	20	59	4,562		メディア・娯楽	
ATR CANADA	—	14	22	1,745		運輸	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	62	120	9,193		公益事業	
PARKLAND FUEL CORP	—	16	54	4,159		エネルギー	
OVINTIV INC	—	33	26	2,056		エネルギー	
小 計	株 数	金 額	4,803	4,665	21,335	1,631,506	
	銘柄 数 < 比率 >		88	83	—	< 3.1% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ				
COMMERZBANK AG	118	118	37	4,392		銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	224	259	165	19,169		各種金融	
SIEMENS AG-REG	85	95	837	97,197		資本財	
RWE AG	56	71	191	22,268		公益事業	
BASF SE	102	114	515	59,861		素材	
VOLKSWAGEN AG	4	4	55	6,454		自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	101	114	354	41,128		自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	20	20	155	18,027		家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	236	284	258	30,003		公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	36	40	206	23,917		自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	104	121	703	81,651		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALLIANZ SE-REG	47	51	801	93,020		保険	
CONTINENTAL AG	12	12	98	11,390		自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	124	162	288	33,511		半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	16	21	100	11,652		自動車・自動車部品	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22	22	17	2,017		運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	8	—	—	—		耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	110	125	335	38,945		運輸	
SAP SE	109	121	1,299	150,819		ソフトウェア・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	29	—	—	—		メディア・娯楽	
DEUTSCHE BOERSE AG	21	23	358	41,568		各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	24	25	186	21,673		ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5	5	20	2,326		運輸	
ADIDAS AG	20	22	461	53,549		耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	369	411	556	64,548		電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	16	17	340	39,473		保険	
THYSSENKRUPP AG	47	47	23	2,685		素材	
BEIERSDORF AG	10	12	118	13,752		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	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		
HEIDELBERGCEMENT AG	15	21	88	10,288	素材	
MERCK KGAA	14	16	178	20,706	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	20	23	298	34,648	自動車・自動車部品	
PUMA SE	0.72	10	59	6,856	耐久消費財・アパレル	
LANXESS AG	11	7	36	4,274	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	45	49	201	23,434	ヘルスケア機器・サービス	
HOCHTIEF AG	3	3	21	2,488	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	40	46	179	20,864	不動産	
GEA GROUP AG	17	17	38	4,517	資本財	
SYMRISE AG	14	16	157	18,319	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	11	13	98	11,400	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11	11	35	4,135	電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	7	5	21	2,483	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	6	6	93	10,816	保険	
BRENNTAG AG	14	20	88	10,295	資本財	
AXEL SPRINGER SE	7	—	—	—	メディア・娯楽	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	4	45	5,272	ヘルスケア機器・サービス	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	9	9	33	3,845	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	95	95	25	2,970	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	9	—	—	—	資本財	
VONOVIA SE	55	61	302	35,049	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	19	28	62	7,202	素材	
ZALANDO SE	15	15	85	9,932	小売	
COVESTRO AG	22	23	70	8,216	素材	
UNIPER SE	28	28	70	8,190	公益事業	
INNOGY SE	12	—	—	—	公益事業	
METRO AG	22	22	18	2,113	食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	6	6	29	3,397	資本財	
I&I DRILLISCH AG	7	—	—	—	電気通信サービス	
MTU AERO ENGINES AG	5	5	72	8,427	資本財	
WIRECARD AG	12	14	131	15,203	ソフトウェア・サービス	
DELIVERY HERO SE	10	13	120	13,987	小売	
SARTORIUS AG-VORZUG	3	4	130	15,083	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17	17	71	8,247	ヘルスケア機器・サービス	
KNORR-BREMSE AG	—	6	51	5,977	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,686	2,958	11,408	1,323,657	
	銘柄 数 < 比 率 >	61	57	—	< 2.5% >	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	131	132	169	19,697	保険	
INTESA SANPAOLO	1,657	1,857	261	30,371	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	1,559	1,310	45	5,292	電気通信サービス	
ENI SPA	282	321	277	32,211	エネルギー	
UNICREDIT SPA	222	239	158	18,344	銀行	
ENEL SPA	904	1,009	613	71,212	公益事業	
RECORDATI SPA	14	15	66	7,687	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	51	62	87	10,125	運輸	
MEDIOBANCA SPA	71	71	38	4,460	銀行	
SNAM SPA	224	267	107	12,489	公益事業	
TELECOM ITALIA-RSP	360	739	26	3,049	電気通信サービス	
LEONARDO SPA	49	49	28	3,360	資本財	
TERNA SPA	132	186	105	12,261	公益事業	
PRYSMIAN SPA	27	27	49	5,755	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		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	65	65	47	5,479	食品・飲料・タバコ	
POSTE ITALIANE SPA	76	56	42	4,979	保険	
FINCOBANK SPA	—	79	79	9,230	銀行	
MONCLER SPA	18	24	79	9,234	耐久消費財・アパレル	
PIRELLI & C SPA	56	56	20	2,360	自動車・自動車部品	
小 計	株数・金額	5,907	6,571	2,306	267,602	
	銘柄数<比率>	18	19	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	18	21	182	21,226	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	31	34	1,202	139,491	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	62	73	97	11,255	自動車・自動車部品	
AXA SA	217	238	384	44,644	保険	
DANONE	68	76	489	56,822	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	60	77	102	11,944	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	112	105	211	24,594	メディア・娯楽	
INGENICO GROUP	8	7	91	10,610	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	85	96	124	14,406	銀行	
ATR LIQUIDE SA	48	58	682	79,131	素材	
TOTAL SA	270	297	962	111,614	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	55	59	148	17,265	資本財	
VINCI SA	55	64	483	56,059	資本財	
SANOFI	125	139	1,242	144,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	54	64	124	14,439	公益事業	
L'OREAL	28	31	797	92,571	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	18	25	58	6,785	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	59	68	551	63,990	資本財	
BNP PARIBAS	125	139	391	45,371	銀行	
ESSILORLUXOTTICA	32	35	399	46,400	耐久消費財・アパレル	
CAPGEMINI SE	17	18	161	18,747	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	7	7	26	3,047	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	28	28	56	6,563	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	3	3	247	28,699	耐久消費財・アパレル	
SODEXO SA	9	12	82	9,593	消費者サービス	
KERING	8	9	413	47,955	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	14	16	221	25,713	ソフトウェア・サービス	
ATOS SE	9	12	79	9,234	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	219	252	268	31,183	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	18	18	16	1,913	保険	
IMERYS SA	5	—	—	—	素材	
SAFRAN SA	37	41	326	37,869	資本財	
RENAULT SA	21	21	38	4,428	自動車・自動車部品	
PUBLICIS GROUPE	22	27	72	8,408	メディア・娯楽	
JCDECAUX SA	9	9	19	2,206	メディア・娯楽	
SOCIETE BIC SA	4	—	—	—	商業・専門サービス	
BOUYGUES SA	22	27	74	8,660	資本財	
THALES SA	12	12	85	9,901	資本財	
PERNOD RICARD SA	23	26	355	41,208	食品・飲料・タバコ	
CREDIT AGRICOLE SA	132	132	92	10,774	銀行	
ENGIE	203	231	225	26,180	公益事業	
ALSTOM	19	21	76	8,900	資本財	
ARKEMA	8	8	63	7,321	素材	
LEGRAND SA	30	33	196	22,807	資本財	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SCOR SE	18	18	43	5,040	保険	
ADP	3	3	25	3,015	運輸	
EDF	75	78	55	6,457	公益事業	
NATIXIS	110	110	23	2,716	各種金融	
WENDEL	3	3	23	2,749	各種金融	
BUREAU VERITAS SA	22	41	76	8,892	商業・専門サービス	
EURAZEO SE	5	3	14	1,685	各種金融	
EURAZEO SE-NEW	0.29	—	—	—	各種金融	
SUEZ	45	52	54	6,341	公益事業	
EIFPAGE	9	9	71	8,297	資本財	
ILIAD SA	2	2	35	4,161	電気通信サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	23	23	20	2,426	メディア・娯楽	
BIOMERIEUX	6	5	66	7,660	ヘルスケア機器・サービス	
GETLINK SE	51	51	58	6,773	運輸	
EDENRED	26	31	122	14,228	ソフトウェア・サービス	
REMY COINTREAU	3	1	20	2,345	食品・飲料・タバコ	
REXEL SA	41	—	—	—	資本財	
BOLLORE	118	118	29	3,465	メディア・娯楽	
DASSAULT AVIATION SA	0.33	0.33	24	2,794	資本財	
SEB SA	3	3	33	3,830	耐久消費財・アパレル	
IPSEN	4	4	33	3,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	4	6	38	4,466	各種金融	
FAURECIA	9	9	32	3,732	自動車・自動車部品	
TELEPERFORMANCE	6	7	165	19,150	商業・専門サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9	12	88	10,304	メディア・娯楽	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3	3	85	9,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WORDLINE SA	9	16	109	12,683	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,049	3,308	13,283	1,541,132	
	銘柄 数 < 比 率 >	71	67	—	< 2.9% >	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N. V.	25	29	118	13,745	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	57	6,685	資本財	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	119	135	103	11,981	自動車・自動車部品	
FERRARI NV	14	14	216	25,147	自動車・自動車部品	
EXOR NV	14	11	54	6,345	各種金融	
AIRBUS SE	64	72	395	45,848	資本財	
STMICROELECTRONICS NV	71	82	187	21,745	半導体・半導体製造装置	
WOLTERS KLUWER	28	33	224	26,040	商業・専門サービス	
UNILEVER NV	—	181	826	95,844	家庭用品・パーソナル用品	
KONINKLIJKE KPN NV	357	466	98	11,454	電気通信サービス	
AKZO NOBEL N. V.	25	24	169	19,648	素材	
HEINEKEN NV	28	31	235	27,270	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	105	111	439	50,972	ヘルスケア機器・サービス	
AEGON NV	216	243	53	6,183	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	131	138	323	37,486	食品・生活必需品小売り	
RANDSTAD NV	11	12	45	5,227	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	11	14	105	12,226	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	19	21	249	28,902	素材	
ING GROEP NV	435	496	245	28,427	銀行	
ASML HOLDING NV	45	52	1,470	170,616	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	172	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	9	9	44	5,200	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	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NN GROUP NV	33	41	105	12,194		保険
ALTICE EUROPE NV	—	77	28	3,333		メディア・娯楽
ABN AMRO BANK NV-CVA	45	45	30	3,522		銀行
ADYEN NV	1	1	125	14,587		ソフトウェア・サービス
JUST EAT TAKEAWAY	—	15	152	17,725		小売
PROSUS NV	—	60	470	54,545		小売
小 計	株 数 ・ 金 額	2,103	2,538	6,575	762,908	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	27	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	26	26	35	4,129		資本財
ENDESA SA	37	37	76	8,852		公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	25	30	72	8,426		資本財
IBERDROLA SA	697	758	656	76,151		公益事業
TELEFONICA SA	516	589	247	28,668		電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	1,816	2,049	397	46,166		銀行
BANKINTER SA	59	94	32	3,809		銀行
REPSOL SA	159	177	150	17,495		エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	743	842	222	25,859		銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	40	32	53	6,156		公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	121	136	314	36,526		小売
MAPPRE SA	144	144	22	2,654		保険
FERROVIAL SA	61	60	139	16,174		資本財
ENAGAS SA	25	34	72	8,365		公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	41	56	87	10,104		公益事業
BANCO DE SABADELL SA	707	564	17	2,021		銀行
CAIXABANK SA	412	412	68	7,926		銀行
GRIFOLS SA	28	35	104	12,078		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA	48	54	214	24,902		ソフトウェア・サービス
BANKIA SA	134	134	11	1,356		銀行
AENA SME SA	7	9	95	11,049		運輸
CELLNEX TELECOM SA	—	31	159	18,513		電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	5,857	6,313	3,252	377,388	
	銘柄 数 < 比 率 >	21	22	—	< 0.7% >	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV	—	6	129	15,031		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGEAS	18	22	73	8,512		保険
UCB SA	14	14	122	14,166		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	9	70	8,206		各種金融
UMICORE	25	23	87	10,113		素材
COLRUYT SA	8	7	42	4,951		食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV	26	30	145	16,858		銀行
SOLVAY SA	7	9	71	8,317		素材
PROXIMUS	20	14	27	3,193		電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	6	6	24	2,810		メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	85	95	377	43,845		食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	220	241	1,172	136,005	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	11	—	< 0.3% >	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	33	33	65	7,609		銀行
VERBUND AG	9	11	52	6,059		公益事業
OMV AG	14	15	46	5,431		エネルギー
VOESTALPINE AG	9	18	34	4,036		素材

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	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ANDRITZ AG	9	9	30	3,568	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	20	20	32	3,750	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	96	109	262	30,454	
		6	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	6	—	—	—	メディア・娯楽	
AROUNDTOWN SA	89	134	67	7,795	不動産	
TENARIS SA	61	69	42	4,897	エネルギー	
SES	44	44	26	3,022	メディア・娯楽	
EUROFINS SCIENTIFIC	1	1	76	8,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	75	75	65	7,582	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	278	324	277	32,229	
		6	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	627	737	244	28,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	52	68	71	8,248	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15	15	27	3,226	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	58	63	158	18,359	素材	
FORTUM OYJ	52	52	80	9,352	公益事業	
KONE OYJ-B	37	40	231	26,857	資本財	
METSO OYJ	12	12	32	3,801	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	47	52	154	17,971	保険	
WARTSILA OYJ ABP	57	60	40	4,680	資本財	
ELISA OYJ	19	18	101	11,741	電気通信サービス	
NESTE OYJ	42	51	164	19,098	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	13	14	71	8,267	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>	1,036	1,189	1,379	159,997	
		12	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	17	19	203	23,661	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	17	17	88	10,304	資本財	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8	10	115	13,371	消費者サービス	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW	—	0.17	1	220	消費者サービス	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	115	115	16	1,873	銀行	
AIB GROUP PLC	92	92	8	989	銀行	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24	31	91	10,628	素材	
CRH PLC	91	93	249	28,892	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	366	381	775	89,940	
		7	8	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	286	337	138	16,048	公益事業	
JERONIMO MARTINS	30	30	48	5,586	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	48	67	68	7,906	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	365	434	254	29,541	
		3	3	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,969	24,370	40,948	4,750,860	
		239	237	—	<9.0%>	
(イギリス)						
BARCLAYS PLC	1,910	2,215	227	30,065	銀行	
BP PLC	2,243	2,505	786	103,977	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,943	8,707	264	35,024	銀行	
ASTRAZENECA PLC	141	162	1,417	187,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
SMITHS GROUP PLC	47	48	60	8,006	資本財
NEXT PLC	14	18	89	11,816	小売
DIAGEO PLC	270	290	823	108,909	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC	369	409	205	27,212	資本財
UNILEVER PLC	123	137	574	75,966	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	1,086	1,243	296	39,147	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	218	241	448	59,303	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	199	199	17	2,310	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	75	88	603	79,809	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	—	47	106	14,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC	289	327	366	48,525	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	687	703	143	18,939	保険
SAGE GROUP PLC/THE	113	137	88	11,700	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	2,240	2,516	1,034	136,773	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	256	284	868	114,794	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	78	78	71	9,499	公益事業
SCHRODERS PLC	17	17	48	6,446	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	527	647	71	9,453	銀行
BHP GROUP PLC	234	265	358	47,365	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	106	116	188	24,902	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	140	171	100	13,355	メディア・娯楽
CENTRICA PLC	690	690	25	3,322	公益事業
BT GROUP PLC	949	1,075	114	15,185	電気通信サービス
SSE PLC	112	124	154	20,383	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	308	321	130	17,196	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	187	215	60	8,052	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	13,333	—	—	—	資本財
COMPASS GROUP PLC	175	202	257	34,075	消費者サービス
KINGFISHER PLC	213	336	54	7,227	小売
PEARSON PLC	77	106	48	6,400	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	22	31	77	10,238	公益事業
RIO TINTO PLC	128	141	519	68,752	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	553	618	1,037	137,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	101	120	88	11,735	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	2,976	3,319	375	49,603	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	256	256	48	6,391	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	223	223	42	5,644	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	444	508	123	16,296	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	22	22	44	5,828	素材
RENTOKIL INITIAL PLC	—	218	104	13,841	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	95	137	52	6,954	保険
WHITBREAD PLC	20	15	43	5,719	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	381	431	399	52,865	公益事業
BUNZL PLC	39	39	68	9,038	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	118	123	176	23,283	素材
INTERTEK GROUP PLC	18	18	88	11,661	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	44	58	79	10,523	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	17	22	77	10,279	消費者サービス
CARNIVAL PLC	19	19	18	2,470	消費者サービス
PERSIMMON PLC	32	40	90	11,953	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	84	84	20	2,741	資本財
ITV PLC	446	446	33	4,375	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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	34	39	314	41,655	各種金融	
G4S PLC	184	184	16	2,246	商業・専門サービス	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	14	14	60	7,976	耐久消費財・アパレル	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98	129	66	8,738	耐久消費財・アパレル	
SMITH & NEPHEW PLC	100	103	166	22,038	ヘルスケア機器・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	323	350	52	6,977	耐久消費財・アパレル	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	504	507	666	88,122	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	418	472	596	78,829	エネルギー	
INVESTEC PLC	88	—	—	—	各種金融	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	250	310	66	8,820	各種金融	
EXPERIAN PLC	101	109	280	37,051	商業・専門サービス	
MONDI PLC	35	55	75	9,957	素材	
WEIR GROUP PLC/THE	30	30	28	3,737	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	38	47	82	10,906	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	53	57	45	6,043	素材	
ADMIRAL GROUP PLC	26	26	63	8,334	保険	
FRESNILLO PLC	29	—	—	—	素材	
BABCOCK INTL GROUP PLC	44	—	—	—	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	48	76	64	8,551	各種金融	
GLENCORE PLC	1,256	1,282	190	25,137	素材	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	9	88	11,676	資本財	
EVRAZ PLC	—	59	15	2,007	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	37	41	66	8,745	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	15	15	75	9,988	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	552	685	64	8,502	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	26	30	55	7,367	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	19	19	9	1,315	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	154	154	42	5,592	保険	
ROYAL MAIL PLC	118	—	—	—	運輸	
AVEVA GROUP PLC	—	7	29	3,889	ソフトウェア・サービス	
ASHTED GROUP PLC	54	56	127	16,814	資本財	
MERLIN ENTERTAINMENT	112	—	—	—	消費者サービス	
TUI AG-DI	42	42	11	1,509	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	41	41	18	2,434	ソフトウェア・サービス	
NMC HEALTH PLC	11	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
OCADO GROUP PLC	—	52	101	13,393	小売	
AUTO TRADER GROUP PLC	99	99	49	6,538	メディア・娯楽	
DCC PLC	11	11	68	9,046	資本財	
GVC HOLDINGS PLC	62	62	48	6,389	消費者サービス	
CONVATEC GROUP PLC	186	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
JOHN WOOD GROUP PLC	64	—	—	—	エネルギー	
INFORMA PLC	137	137	59	7,847	メディア・娯楽	
FERGUSON PLC	24	27	159	21,067	資本財	
M&G PLC	—	278	35	4,741	各種金融	
JD SPORTS FASHION PLC	—	50	26	3,565	小売	
小計	株数・金額	46,887	37,231	17,705	2,341,577	
	銘柄数<比率>	93	92	—	<4.4%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	342	368	3,888	428,992	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	58	65	362	39,955	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	282	327	260	28,727	各種金融	
LAFARGEHOCLIM LTD-REG	54	59	231	25,546	素材	

銘柄	株数	当 期 末		評 価 額		業 種 等
		株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株				
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	78	86	2,998	330,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	1	1	379	41,829	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	6	7	136	15,072	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	16	18	526	58,098	保険	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.99	1	97	10,755	ヘルスケア機器・サービス	
LONZA GROUP AG-REG	8	9	416	45,946	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	26	2,967	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5	5	115	12,795	資本財	
GEBERIT AG-REG	4	4	202	22,311	資本財	
SWISS RE AG	34	37	249	27,513	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3	3	58	6,473	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	2	4	30	3,314	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	242	266	2,225	245,471	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	22	92	10,165	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	2	3	160	17,665	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	206	228	406	44,848	資本財	
CLARIANT AG-REG	19	30	54	6,028	素材	
SGS SA-REG	0.55	0.74	160	17,658	商業・専門サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1	2	44	4,902	資本財	
TEMENOS AG - REG	6	8	108	11,920	ソフトウェア・サービス	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	5	5	80	8,893	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	5	5	76	8,489	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3	4	147	16,236	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	82	9,101	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	24	31	115	12,764	各種金融	
SIKA AG-REG	13	15	253	28,019	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	10	9	91	10,128	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.13	0.13	102	11,308	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1	2	181	20,055	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.31	0.35	65	7,216	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	1	72	7,950	素材	
UBS GROUP AG-REG	432	476	451	49,843	各種金融	
DUFREY AG-REG	2	4	12	1,392	小売	
VIFOR PHARMA AG	4	5	84	9,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALCON INC	48	53	279	30,817	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,958	2,185	15,330	1,691,307	
	銘柄 数 < 比率 >	39	39	—	< 3.2% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	22	39	547	5,949	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	343	387	3,247	35,265	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	44	52	1,651	17,934	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	182	211	1,571	17,067	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	50	54	2,610	28,352	各種金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	169	191	1,698	18,443	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	72	79	2,755	29,922	資本財	
SKF AB-B SHARES	36	43	674	7,327	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	112	124	2,303	25,018	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	97	97	1,278	13,882	小売	
SANDVIK AB	127	142	2,112	22,940	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	103	118	1,258	13,671	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	42	30	356	3,867	商業・専門サービス	
SKANSKA AB-B SHS	30	41	753	8,185	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	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	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
SWEDISH MATCH AB	20	20	1,275	13,854	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	49	52	671	7,291	電気通信サービス	
TELIA CO AB	318	318	1,040	11,298	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	168	192	2,390	25,958	資本財	
ALFA LAVAL AB	35	35	661	7,187	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	24	25	580	6,308	エネルギー	
BOLIDEN AB	25	33	658	7,146	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	56	56	325	3,530	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7	11	260	2,827	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	27	33	1,578	17,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINNEVIK AB - B	28	28	628	6,828	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25	16	321	3,492	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	12	13	569	6,179	食品・生活必需品小売り	
LUNDBERGS AB-B SHS	11	11	463	5,032	各種金融	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	70	72	2,297	24,946	家庭用品・パーソナル用品	
EPIROC AB-B	44	44	450	4,896	資本財	
EPIROC AB-A	72	93	961	10,439	資本財	
NORDEA BANK ABP	328	415	2,451	26,618	銀行	
小計	株数・金額	2,764	3,092	40,405	438,808	
	銘柄数<比率>	32	32	-	<0.8%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	108	113	1,325	13,767	銀行	
NORSK HYDRO ASA	128	219	511	5,315	素材	
ORKLA ASA	97	99	838	8,714	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	131	131	1,855	19,279	エネルギー	
TELENOR ASA	83	83	1,257	13,064	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	16	19	635	6,605	素材	
MOWI ASA	46	57	1,031	10,719	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21	21	382	3,976	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	13	13	277	2,887	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	13	13	234	2,439	エネルギー	
小計	株数・金額	662	772	8,351	86,769	
	銘柄数<比率>	10	10	-	<0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	202	219	9,652	150,189	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	858	13,361	素材	
DANSKE BANK A/S	81	82	624	9,710	銀行	
DEMANT A/S	16	10	179	2,789	ヘルスケア機器・サービス	
H LUNDBECK A/S	8	8	214	3,343	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	21	24	1,462	22,752	資本財	
CARLSBERG AS-B	11	13	1,111	17,292	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	11	15	1,575	24,513	ヘルスケア機器・サービス	
DSV PANALPINA A/S	20	25	1,844	28,697	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.82	0.88	569	8,856	運輸	
TRYG A/S	14	14	269	4,190	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	0.51	307	4,781	運輸	
PANDORA A/S	11	11	309	4,814	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	23	15	154	2,402	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	9	13	864	13,445	素材	
GENMAB A/S	7	7	1,504	23,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

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	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
ORSTED A/S	21	22	1,572	24,472		公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	487	511	23,073	359,022	
	銘柄 数 < 比 率 >	17	17	—	< 0.7% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP GROUP LTD	329	368	1,161	80,379		素材
CSL LTD	50	56	1,699	117,604		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	328	328	50	3,501		素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	104	115	257	17,837		エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	321	352	557	38,588		銀行
RTIO TINTO LTD	42	48	403	27,913		素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	141	167	128	8,867		保険
LENLELEASE GROUP	74	75	84	5,871		不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	198	219	1,318	91,279		銀行
WESTPAC BANKING CORP	385	450	703	48,722		銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	307	394	630	43,638		銀行
BRAMBLES LTD	168	197	213	14,807		商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	—	81	28	1,998		運輸
BORAL LTD	150	150	41	2,893		素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	142	155	541	37,483		食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	462	560	171	11,901		電気通信サービス
AMP LTD	303	513	73	5,065		各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	233	233	75	5,253		消費者サービス
AMCOR LIMITED	131	—	—	—		素材
COMPUTERSHARE LTD	52	52	62	4,329		ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	66	66	169	11,725		消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	36	41	467	32,360		各種金融
CIMIC GROUP LTD	13	13	31	2,191		資本財
ASX LTD	17	25	214	14,818		各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	74	76	66	4,599		食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	6	6	131	9,107		ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	41	53	119	8,265		素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	108	40	12	844		小売
NEWCREST MINING LTD	85	95	266	18,438		素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	238	298	163	11,287		保険
ORIGIN ENERGY LTD	176	257	143	9,962		エネルギー
ORICA LTD	53	61	98	6,800		素材
SONIC HEALTHCARE LTD	56	57	151	10,495		ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	209	209	103	7,170		エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	143	175	162	11,254		保険
TRANSURBAN GROUP	295	353	487	33,735		運輸
WESFARMERS LTD	126	135	514	35,597		小売
BLUESCOPE STEEL LTD	67	50	52	3,660		素材
CHALLENGER LTD	81	49	22	1,587		各種金融
SYDNEY AIRPORT	146	152	86	5,977		運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	22	33	84	5,859		エネルギー
OIL SEARCH LTD	131	140	40	2,835		エネルギー
WORLEY LTD	40	40	35	2,486		エネルギー
AGL ENERGY LTD	70	89	149	10,362		公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	180	178	216	14,998		素材
AUSNET SERVICES	268	268	52	3,646		公益事業
CROWN RESORTS LTD	23	49	46	3,216		消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	224	227	49	3,450		素材

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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	66	66	39	2,749	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	177	219	101	7,022	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	73	109	112	7,817	食品・飲料・タバコ	
APA GROUP	—	145	168	11,641	公益事業	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	17	21	133	9,230	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	9	3	3	255	消費者サービス	
SEEK LTD	39	39	69	4,800	メディア・娯楽	
BANK OF QUEENSLAND LTD	54	—	—	—	銀行	
REA GROUP LTD	8	5	49	3,428	メディア・娯楽	
TPG TELECOM LTD	63	26	19	1,348	電気通信サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	331	331	92	6,417	保険	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	11	—	—	—	消費者サービス	
SOUTH32 LTD	556	556	107	7,412	素材	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	14	77	5,379	各種金融	
WASHINGTON H. SOUL PATINSON	19	19	34	2,419	エネルギー	
COLES GROUP LTD	117	140	212	14,731	食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	—	16	32	2,222	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,487 61	9,491 62	13,604 —	941,551 <1.8%>	
(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	112	7,307	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	135	102	61	3,999	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	60	71	209	13,641	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	74	74	25	1,647	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	50	50	61	4,033	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	95	170	81	5,285	公益事業	
MERCURY NZ LTD	—	79	39	2,557	公益事業	
A2 MILK CO LTD	81	101	194	12,647	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	739 7	891 8	785 —	51,120 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	170	—	—	—	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	55	55	278	3,863	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	298	323	1,849	25,651	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	175	205	2,095	29,059	不動産	
MTR CORP	180	190	813	11,279	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	1,012	1,243	1,716	23,806	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	730	669	9,284	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	140	180	909	12,620	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	134	149	3,725	51,665	各種金融	
HANG LUNG GROUP LTD	140	—	—	—	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	220	220	374	5,187	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	185	205	1,643	22,789	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	173	191	598	8,299	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	170	170	279	3,871	銀行	
HANG SENG BANK LTD	85	96	1,320	18,308	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	100	—	—	—	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	200	—	—	—	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	34	34	275	3,819	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	390	390	432	5,993	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	95	95	125	1,736	耐久消費財・アパレル	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	90	95	439	6,100	公益事業	

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 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		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	380	465	1,134	15,736	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	135	170	1,131	15,691	資本財	
PCCW LTD	530	530	252	3,506	電気通信サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	95	95	207	2,879	不動産	
MINTH GROUP LTD	100	—	—	—	自動車・自動車部品	
NWS HOLDINGS LTD	200	200	155	2,149	資本財	
SANDS CHINA LTD	268	324	1,041	14,447	消費者サービス	
WHEELOK & CO LTD	80	110	636	8,826	不動産	
WYNN MACAU LTD	216	152	218	3,035	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	280	280	231	3,207	消費者サービス	
AIA GROUP LTD	1,346	1,496	10,576	146,699	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	154	172	377	5,236	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	260	260	1,410	19,563	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	112	—	—	—	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	470	470	604	8,383	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	1,050	1,275	919	12,750	食品・飲料・タバコ	
CK ASSET HOLDINGS LTD	273	313	1,563	21,685	不動産	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	320	255	3,541	公益事業	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	140	471	6,534	不動産	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	80	228	3,162	食品・飲料・タバコ	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	193	448	6,223	食品・飲料・タバコ	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,717 39	11,617 36	39,408 —	546,599 <1.0%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	342	414	370	28,028	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	207	207	32	2,429	メディア・娯楽	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123	123	19	1,508	資本財	
CAPITALAND LTD	289	289	85	6,456	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	59	59	47	3,583	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	12	12	24	1,862	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	199	226	452	34,229	銀行	
KEPPEL CORP LTD	134	178	108	8,182	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	146	161	323	24,470	銀行	
VENTURE CORP LTD	32	32	50	3,816	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	223	158	52	3,996	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	841	993	273	20,679	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	60	60	26	2,003	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	110	113	112	8,489	各種金融	
UOL GROUP LTD	75	79	55	4,187	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	282	282	45	3,416	運輸	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,292	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	202	202	71	5,415	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE LTD	656	656	50	3,825	消費者サービス	
SATS LTD	30	89	26	2,028	運輸	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	291	291	29	2,247	資本財	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,605 21	4,624 20	2,256 —	170,860 <0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ICL LTD	93	93	116	3,576	素材	
BANK HAPOALIM BM	119	148	333	10,204	銀行	
NICE LTD	6	8	518	15,900	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	182	159	308	9,445	銀行	

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	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエルシェケル	千円		
ELBIT SYSTEMS LTD	2	2	140	4,297		資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	126	144	4,442		銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	255	—	—	—		電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16	16	118	3,636		銀行
AZRIELI GROUP LTD	4	4	82	2,525		不動産
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	681 8	560 8	1,763 —	54,030 <0.1%>	
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	139,603 1,252	137,420 1,253	— —	46,392,625 <88.1%>	

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

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

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	%
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4	5	140	15,136	0.0
MACERICH CO/THE	1	—	—	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	1	225	24,253	0.0
PROLOGIS INC	6	9	805	86,571	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	1	112	12,095	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2	2	66	7,170	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	2	3	468	50,383	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	2	141	15,183	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.75	0.774	188	20,215	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	1	148	15,934	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.847	0.847	63	6,852	0.0
WELLTOWER INC	4	5	223	24,031	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	1	1	157	16,969	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	7	127	13,660	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	1	157	16,986	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	2	66	7,097	0.0
REALTY INCOME CORP	3	4	224	24,133	0.0
REGENCY CENTERS CORP	1	2	94	10,170	0.0
SL GREEN REALTY CORP	0.832	0.895	40	4,357	0.0
SUN COMMUNITIES INC	—	1	166	17,907	0.0
UDR INC	2	3	137	14,745	0.0
VENTAS INC	4	4	131	14,150	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16	—	—	—	—
WEYERHAEUSER CO	8	9	175	18,824	0.0
AMERICAN TOWER CORP	4	5	1,303	140,136	0.3
AGNC INVESTMENT CORP	5	—	—	—	—
WP CAREY INC	1	2	141	15,259	0.0
VEREIT INC	11	13	71	7,683	0.0
DUKE REALTY CORP	4	4	155	16,717	0.0
IRON MOUNTAIN INC	3	3	91	9,881	0.0
EQUINIX INC	0.897	1	713	76,689	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	4	5	819	88,085	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	3	4	295	31,800	0.1
INVITATION HOMES INC	3	7	180	19,432	0.0
VICI PROPERTIES INC	—	5	87	9,430	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	1	—	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	1	420	45,182	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	7	9	99	10,722	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	1	1	362	38,951	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	3	4	222	23,872	0.0
VORNADO REALTY TRUST	1	2	90	9,682	0.0
KIMCO REALTY CORP	5	5	51	5,564	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	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1	1	277	29,839	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	135	152	9,447	1,015,766	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	39	—	<1.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		0.9	0.9	17	1,342	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		—	0.9	43	3,355	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		1	1	14	1,117	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		2	2	29	2,252	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	1	23	1,816	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	4	7	129	9,883	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	5	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		0.418	0.549	60	7,044	0.0
KLEPIERRE		2	2	34	3,993	0.0
COVIVIO		0.467	0.674	35	4,074	0.0
ICADE		0.44	0.272	18	2,092	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3	3	148	17,204	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1	1	82	9,581	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1	1	82	9,581	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	4	5	230	26,786	
	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	35	4,683	0.0
HAMMERSON PLC		10	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		7	7	47	6,347	0.0
SEGRO PLC		13	13	112	14,910	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	40	30	196	25,941	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	3	—	<0.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		29	41	61	4,247	0.0
SCENTRE GROUP		61	61	139	9,667	0.0
GPT GROUP		15	23	97	6,767	0.0
MIRVAC GROUP		39	42	95	6,608	0.0
STOCKLAND		22	28	80	5,540	0.0
DEXUS		11	15	139	9,663	0.0
GOODMAN GROUP		18	19	289	20,055	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	198	232	903	62,549	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		22	25	1,751	24,290	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	22	25	1,751	24,290	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<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	%	
SUNTEC REIT	32	17	24	1,852	0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	27	27	43	3,295	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	24	47	3,570	0.0	
CAPITALAND MALL TRUST	32	32	59	4,525	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	27	39	118	8,996	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	118	141	293	22,240	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	525	593	—	1,187,459	
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	65	—	<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
		百万円	百万円
外 国	株式先物取引		
	SP EMINI	3,771	—
	SP/TSE60	181	—
	SWISS IX	181	—
	EURO ST	635	—
	SPI 200	199	—
	FTSE100	258	—

(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

(2020年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	46,392,625	87.7
投資証券	1,187,459	2.2
コール・ローン等、その他	5,320,959	10.1
投資信託財産総額	52,901,043	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(49,625,939千円)の投資信託財産総額(52,901,043千円)に対する比率は93.8%です。

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

1 アメリカドル=107.52円	1 カナダドル=76.47円	1 ユーロ=116.02円	1 イギリスポンド=132.25円
1 スイスフラン=110.32円	1 スウェーデンクローネ=10.86円	1 ノルウェークローネ=10.39円	1 デンマーククローネ=15.56円
1 オーストラリアドル=69.21円	1 ニュージーランドドル=65.12円	1 香港ドル=13.87円	1 シンガポールドル=75.73円
1 イスラエルシェケル=30.64円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月12日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	102,399,873,772
コール・ローン等	3,624,126,702
株式(評価額)	46,392,625,917
投資証券(評価額)	1,187,459,395
未収入金	49,952,620,179
未収配当金	51,415,611
差入委託証拠金	1,191,625,968
(B) 負債	49,743,297,267
未払金	49,740,822,210
未払解約金	2,473,138
未払利息	1,919
(C) 純資産総額(A-B)	52,656,576,505
元本	29,819,008,775
次期繰越損益金	22,837,567,730
(D) 受益権総口数	29,819,008,775口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,659円

<注記事項>

- ①期首元本額 27,637,491,756円
 期中追加設定元本額 9,426,531,010円
 期中一部解約元本額 7,245,013,991円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7659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)

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)	20,751,750,081円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,538,069,951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)	1,694,594,962円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,596,151,993円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	1,563,451,383円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	1,510,804,125円
つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)	141,251,844円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	22,934,436円
合計	29,819,008,775円

【お知らせ】

株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2019年7月1日)

○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	964,311,414
受取配当金	954,962,657
受取利息	6,789,807
その他収益金	5,514,814
支払利息	△ 2,955,864
(B) 有価証券売買損益	△ 1,842,395,840
売買益	9,985,419,272
売買損	△ 11,827,815,112
(C) 先物取引等取引損益	△ 422,267,840
取引益	1,029,185,687
取引損	△ 1,451,453,527
(D) 保管費用等	△ 17,354,053
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 1,317,706,319
(F) 前期繰越損益金	22,102,960,068
(G) 追加信託差損益金	8,067,463,079
(H) 解約差損益金	△ 6,015,149,098
(I) 計(E+F+G+H)	22,837,567,730
次期繰越損益金(I)	22,837,567,730

(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。