

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（2018年7月3日設定）	
運用方針	<p>S & P 5 0 0 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 S & P 5 0 0 指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている米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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p>	
主要運用対象	ベビーファンド	S & P 5 0 0 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、米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	米国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	<p>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。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>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。）</p> </div>	

※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）

eMAXIS
イーマックス

eMAXIS Slim
米国株式（S & P 5 0 0）

第1期（決算日：2019年4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「eMAXIS Slim 米国株式（S & P 5 0 0）」は、去る4月25日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

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			S & P 5 0 0 指数		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(配当込み、円換算ベース)	期中騰落率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2018年7月3日	10,000	—	—	17,626	—	—	—	—	1
1期(2019年4月25日)	11,035	0	10.4	19,441	10.3	92.3	5.3	2.7	17,010

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) S & P 5 0 0[®]指数とは、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックス L L C が公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

S & P 5 0 0 指数 (配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 指数 (配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。

S & P 5 0 0 指数は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社 (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

(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		S & P 5 0 0 指 数		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	(配当込み、 円換算ベース)	騰 落 率			
(設定日) 2018年7月3日	円 10,000	% —	17,626	% —	% —	% —	% —
7月末	10,330	3.3	18,210	3.3	95.4	2.1	2.6
8月末	10,714	7.1	18,887	7.2	92.1	3.4	2.5
9月末	11,016	10.2	19,419	10.2	93.7	4.0	2.4
10月末	10,121	1.2	17,843	1.2	93.1	4.7	2.6
11月末	10,368	3.7	18,273	3.7	90.5	6.8	2.6
12月末	9,231	△ 7.7	16,267	△ 7.7	93.1	4.5	2.7
2019年1月末	9,770	△ 2.3	17,219	△ 2.3	93.1	4.2	2.8
2月末	10,372	3.7	18,277	3.7	90.4	2.7	2.6
3月末	10,484	4.8	18,470	4.8	93.7	3.5	2.8
(期 末) 2019年4月25日	11,035	10.4	19,441	10.3	92.3	5.3	2.7

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第1期：2018年7月3日～2019年4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1期首	10,000円
第1期末	11,035円
既払分配金	0円
騰落率	10.4%

※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

基準価額は設定時に比べ10.4%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（10.3%）を0.1%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、米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1期：2018年7月3日～2019年4月25日

投資環境について

▶ 米国株式市況

米国株式市況は、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。

▶ 為替市況

為替市況は、設定時に比べて1.3%の円安・米ドル高となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS Slim 米国株式 (S&P500)

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。

▶ S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド

基準価額は設定時に比べ10.5%の上昇となりました。

S & P 5 0 0 指数（ネット配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。

株式の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

▶ eMAXIS Slim 米国株式 (S&P500)

ベンチマークとの乖離は0.1%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△0.1%程度でした。

マザーファンド保有による要因

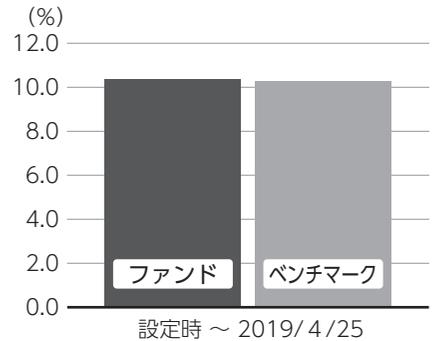
マザーファンド保有による影響は0.2%程度でした。

主なプラス要因：その他の要因

※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：取引要因

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1期 2018年7月3日～2019年4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	1,035

(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。)

▶ eMAXIS Slim 米国株式 (S&P500)

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ S&P500 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。

2018年7月3日～2019年4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	14	0.138	(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)	(6)	(0.061)	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)	(6)	(0.061)	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)	(0.017)	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	0.011	(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)	(0.008)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(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)	(0)	(0.002)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	5	0.052	(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)	(0.045)	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)	(0.004)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	20	0.203	

期中の平均基準価額は、10,312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。

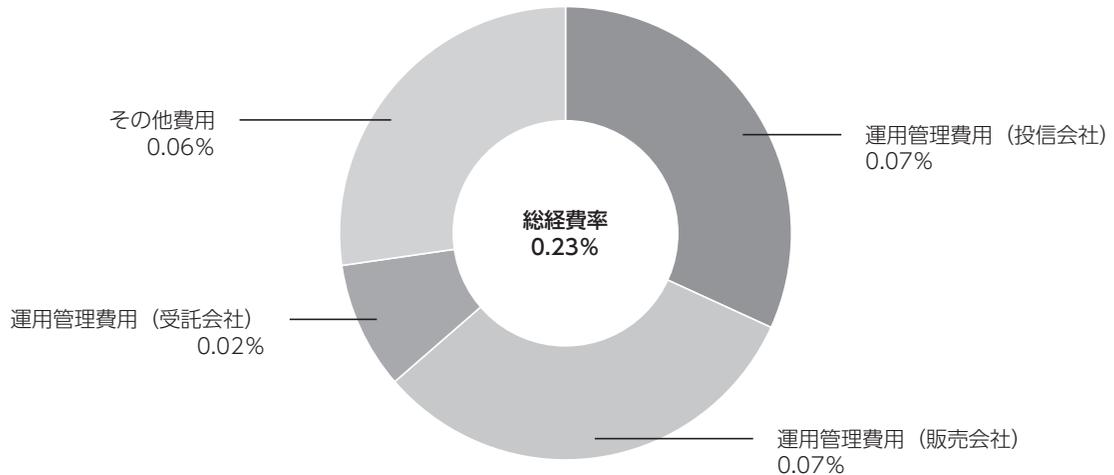
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.23%**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7月3日～2019年4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
S&P500インデックスマザーファンド	千口 8,666,010	千円 15,875,589	千口 24,863	千円 45,532

○株式売買比率

(2018年7月3日～2019年4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	
	S&P500インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	61,326,989千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	28,411,355千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.15	

(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7月3日～2019年4月25日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS Slim 米国株式 (S&P500) >

該当事項はございません。

< S&P500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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 24,787	百万円 15,722	% 63.4	百万円 50,233	百万円 46,556	% 92.7

平均保有割合 27.8%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2018年7月3日～2019年4月25日)

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 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4月25日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド		千口 8,641,146	千円 17,008,369

○投資信託財産の構成

(2019年4月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド	千円 17,008,369	% 99.3
コール・ローン等、その他	123,847	0.7
投資信託財産総額	17,132,216	100.0

(注) S & P 5 0 0 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 (31,202,984千円) の投資信託財産総額 (31,289,132千円) に対する比率は99.7%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=112.28円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年4月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,132,216,603
コール・ローン等	123,847,367
S&P500インデックスマザーファンド(評価額)	17,008,369,236
(B) 負債	122,085,385
未払解約金	115,116,723
未払信託報酬	6,836,011
未払利息	244
その他未払費用	132,407
(C) 純資産総額(A-B)	17,010,131,218
元本	15,414,538,687
次期繰越損益金	1,595,592,531
(D) 受益権総口数	15,414,538,687口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,035円

<注記事項>

- ①設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 19,331,432,050円
 期中一部解約元本額 3,917,893,363円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1035円です。

○損益の状況 (2018年7月3日～2019年4月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 18,223
受取利息	34
支払利息	△ 18,257
(B) 有価証券売買損益	1,190,469,138
売買益	1,269,443,862
売買損	△ 78,974,724
(C) 信託報酬等	△ 10,753,140
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,179,697,775
(E) 追加信託差損益金	415,894,756
(配当等相当額)	(△ 27,501)
(売買損益相当額)	(415,922,257)
(F) 計(D+E)	1,595,592,531
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	1,595,592,531
追加信託差損益金	415,894,756
(配当等相当額)	(27,663,288)
(売買損益相当額)	(388,231,468)
分配準備積立金	1,179,697,775

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

②分配金の計算過程

項 目	2018年7月3日～ 2019年4月25日
費用控除後の配当等収益額	123,794,306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	1,055,903,469円
収益調整金額	415,894,756円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	1,595,592,531円
1万口当たり収益分配対象額	1,035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。

S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2019年2月25日

[計算期間：2018年8月28日～2019年2月25日]

「S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド」は、2月25日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックスに採用されている米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。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。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。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	米国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 5 0 0 指数		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	(ネット配当込み、円換算ベース)	騰落率				
7期(2017年2月27日)	15,356	22.8	15,249	22.4	92.1	2.8	2.6	23,062
8期(2017年8月25日)	15,611	1.7	15,484	1.5	94.4	2.6	2.9	30,679
9期(2018年2月26日)	17,260	10.6	17,099	10.4	94.1	3.4	2.4	42,073
10期(2018年8月27日)	18,934	9.7	18,734	9.6	77.0	2.1	2.1	28,510
11期(2019年2月25日)	18,478	△ 2.4	18,260	△ 2.5	94.4	3.0	2.8	36,436

(注) S & P 5 0 0 指数 (ネット配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 指数 (ネット配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。S & P 5 0 0 指数はS&P Dow Jones Indices LLC (「SPDJ」) の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。

Standard & Poor's[®]およびS & P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 5 0 0 指数の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 5 0 0 指 数 (ネット配当込み、 円換算ベース)		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) 2018年8月27日	円	%		%	%	%	%
8月末	18,934	—	18,734	—	77.0	2.1	2.1
9月末	19,088	0.8	18,887	0.8	92.1	3.4	2.5
10月末	19,630	3.7	19,419	3.7	93.7	4.0	2.4
11月末	18,037	△ 4.7	17,843	△ 4.8	93.1	4.7	2.6
12月末	18,480	△ 2.4	18,273	△ 2.5	90.5	6.8	2.6
2019年1月末	16,455	△13.1	16,267	△13.2	93.1	4.5	2.7
(期 末) 2019年2月25日	17,419	△ 8.0	17,219	△ 8.1	93.1	4.2	2.8
	18,478	△ 2.4	18,260	△ 2.5	94.4	3.0	2.8

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

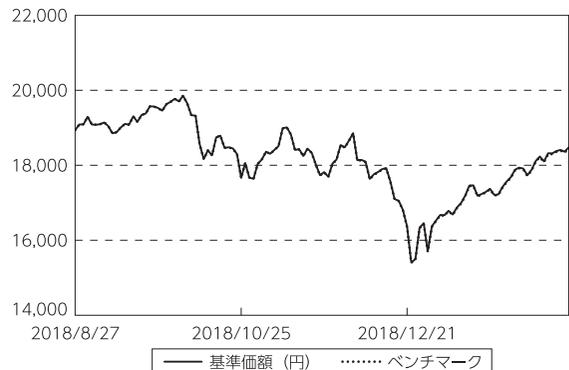
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.4%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(−2.5%)を0.1%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

◎米国株式市況

- ・米国株式市況は、米中貿易摩擦を巡る懸念などを背景に、下落しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて0.4%の円高・米ドル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・S & P 5 0 0 指数(ネット配当込み、円換算ベース)に採用されている株式(先物・不動産投資信託証券(REIT)を含む)を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは2.5%の下落となったため、乖離は0.1%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)

その他の要因

※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)

取引コスト要因

○今後の運用方針

- ・ファンドの資産のほぼ全額を株式(先物・REITを含む)に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2018年8月28日～2019年2月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 1 (1) (0) (0)	% 0.006 (0.004) (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)	0 (0) (0)	0.000 (0.000) (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) (0)	0.031 (0.029) (0.002)	(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	7	0.037	
期中の平均基準価額は、18,149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8月28日～2019年2月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 19,852 (148)	千アメリカドル 155,462 (238)	百株 5,303 (116)	千アメリカドル 43,548 (1,405)

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	3	91	0.668	16
MACERICH CO/THE	0.424	21	0.346	17
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.746	90	0.139	17
PROLOGIS INC	4	296	1	78
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	152	0.293	32
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.472	120	0.095	23
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.738	66	0.199	16
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.381	46	—	—
WELLTOWER INC	2	168	0.525	32
BOSTON PROPERTIES INC	1	129	0.22	26
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.878	86	0.265	25
REALTY INCOME CORP	2	129	0.369	20
REGENCY CENTERS CORP	1	87	0.34	21
SL GREEN REALTY CORP	0.781	71	0.177	16
UDR INC	1	66	0.426	16
VENTAS INC	2	142	0.501	26
WEYERHAEUSER CO	5	137	1	33
AMERICAN TOWER CORP	3	491	0.779	112
DUKE REALTY CORP	2	66	0.611	16
IRON MOUNTAIN INC	2	91	0.872	29
EQUINIX INC	0.565	215	0.159	67
CROWN CASTLE INTL CORP	2	327	0.772	83
EQUITY RESIDENTIAL	2	161	0.527	34
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	2	55
	(2)	(63)		
GGP INC	—	—	—	—
			(7)	(156)
HOST HOTELS & RESORTS INC	5	89	1	21
PUBLIC STORAGE	1	212	0.318	62
SIMON PROPERTY GROUP INC	2	371	0.558	94
VORNADO REALTY TRUST	1	66	0.247	17
KIMCO REALTY CORP	3	55	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.904	162	0.196	34
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	1	51	—	—
			(0.073)	(—)
小 計	58	4,270	15	1,052
	(2)	(63)	(7)	(156)

(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 12,969	百万円 12,503	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8月28日～2019年2月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	22,237,504千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,845,553千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.93

(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8月28日～2019年2月25日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 10,711	% 55.0		百万円 6,678	% 99.8	

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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2019年2月25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	59	95	1,026	113,761	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	145	239	1,820	201,683	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26	43	338	37,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4	7	86	9,611	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	36	60	925	102,579	ソフトウェア・サービス
AES CORP	50	91	160	17,732	公益事業
AFLAC INC	64	106	519	57,515	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	74	123	529	58,647	保険
APACHE CORP	31	47	157	17,489	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	68	113	276	30,615	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	5	98	10,933	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	53	86	1,398	154,971	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18	30	550	60,958	素材
ALASKA AIR GROUP INC	10	15	98	10,859	運輸
ANTHEM INC	21	35	1,117	123,776	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	42	68	299	33,197	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	114	185	752	83,366	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	40	69	517	57,282	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	45	71	3,050	337,900	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	22	36	920	102,027	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	20	31	187	20,762	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	136	222	1,133	125,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	10	16	721	79,923	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	343	562	3,201	354,639	電気通信サービス
BALL CORP	28	48	269	29,837	素材
ALLSTATE CORP	29	45	434	48,118	保険
AVERY DENNISON CORP	7	12	135	15,021	素材
CHUBB LTD	38	63	856	94,919	保険
ANALOG DEVICES INC	30	48	518	57,396	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	2	3	314	34,842	小売
CVS HEALTH CORP	84	176	1,090	120,833	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	69	107	376	41,676	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	283	452	4,755	526,832	銀行
CIGNA CORP	20	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	49	80	1,115	123,625	資本財
COCA-COLA CO/THE	318	521	2,363	261,836	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40	65	532	59,018	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	17	26	85	9,474	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	72	107	789	87,466	運輸
CHEVRON CORP	159	260	3,104	343,929	エネルギー
TAPESTRY INC	24	37	134	14,903	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	13	—	—	—	資本財
CONOCOPHILLIPS	97	157	1,104	122,322	エネルギー
CME GROUP INC	28	49	875	96,970	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	25	38	213	23,646	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	72	115	775	85,932	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	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	
DOMINION ENERGY INC	54	105	789	87,472	公益事業
DEVON ENERGY CORP	43	69	205	22,732	エネルギー
DEERE & CO	27	43	718	79,575	資本財
DANAHER CORP	51	84	960	106,365	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	123	202	2,334	258,641	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	10	18	201	22,347	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	58	98	884	97,968	公益事業
DR HORTON INC	28	50	206	22,924	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	44	72	525	58,268	小売
DAVITA INC	11	16	98	10,957	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	12	18	174	19,321	資本財
DTE ENERGY COMPANY	15	25	309	34,264	公益事業
EXXON MOBIL CORP	352	576	4,519	500,652	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17	29	505	56,013	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	48	78	751	83,223	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	52	86	592	65,596	資本財
EXELON CORP	80	131	643	71,234	公益事業
ECOLAB INC	21	34	583	64,662	素材
EQUIFAX INC	10	17	196	21,816	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	18	29	465	51,567	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	36	57	463	51,354	資本財
EDISON INTERNATIONAL	27	45	282	31,246	公益事業
ENTERGY CORP	15	22	212	23,585	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	3	4	107	11,856	保険
NEXTERA ENERGY INC	39	64	1,220	135,258	公益事業
MACY'S INC	25	41	98	10,928	小売
FEDEX CORP	20	33	602	66,722	運輸
FORD MOTOR CO	327	552	480	53,282	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	26	44	144	16,047	各種金融
FOOT LOCKER INC	11	17	101	11,271	小売
FIRSTENERGY CORP	37	67	275	30,480	公益事業
FLUOR CORP	12	21	82	9,122	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	112	204	269	29,909	素材
GENERAL MILLS INC	49	80	373	41,327	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	23	37	653	72,384	資本財
WW GRAINGER INC	4	6	206	22,908	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	723	1,183	1,203	133,377	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	13	22	282	31,313	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	12	19	217	24,047	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17	27	53	5,905	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	16	25	62	6,936	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29	47	930	103,092	各種金融
HALLIBURTON CO	73	117	368	40,785	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	62	100	1,542	170,852	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	13	20	75	8,320	自動車・自動車部品
HP INC	136	221	526	58,360	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29	51	251	27,805	保険
HERSHEY CO/THE	11	17	197	21,856	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	96	154	2,963	328,326	小売
HASBRO INC	8	15	135	14,995	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	20	33	352	39,071	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71	123	1,721	190,697	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	
INTERNATIONAL PAPER CO	34	56	262	29,084	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	25	42	608	67,434	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	30	52	124	13,847	メディア・娯楽
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6	15	192	21,307	素材
JOHNSON & JOHNSON	223	365	4,989	552,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	8	13	155	17,207	運輸
KELLOGG CO	20	37	212	23,510	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	29	47	568	62,961	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	122	200	954	105,744	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	67	108	310	34,371	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	13	21	138	15,388	小売
ELI LILLY & CO	79	128	1,592	176,448	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	8	13	195	21,654	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	44	67	363	40,291	運輸
LENNAR CORP-A	22	36	184	20,485	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	68	109	1,165	129,074	小売
LEGGETT & PLATT INC	9	14	68	7,613	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	21	31	85	9,418	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	20	33	1,038	115,068	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	17	26	166	18,473	保険
L3 TECHNOLOGIES INC	6	10	218	24,235	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	24	37	482	53,466	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	65	105	1,926	213,406	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	20	34	689	76,351	各種金融
MEDTRONIC PLC	112	182	1,714	189,900	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	223	354	2,861	316,981	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	96	154	656	72,672	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	30	54	76	8,516	耐久消費財・アパレル
3M CO	49	79	1,658	183,771	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13	22	317	35,169	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41	73	202	22,458	消費者サービス
MASCO CORP	25	44	166	18,471	資本財
M & T BANK CORP	12	19	329	36,531	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	42	69	639	70,887	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	5	9	135	14,973	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	113	174	730	80,881	各種金融
MCKESSON CORP	16	26	347	38,499	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	84	135	605	67,128	保険
MOODY'S CORP	13	22	386	42,797	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	23	37	681	75,538	運輸
BANK OF AMERICA CORP	785	1,243	3,615	400,491	銀行
NISOURCE INC	31	50	135	14,962	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	14	23	681	75,544	資本財
NEWMONT MINING CORP	44	74	270	30,014	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	87	144	737	81,690	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10	17	234	25,969	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	26	40	250	27,738	素材
NEWELL BRANDS INC	40	54	93	10,322	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	36	66	335	37,203	メディア・娯楽
NOBLE ENERGY INC	39	61	142	15,750	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	63	101	671	74,388	エネルギー
OMNICOM GROUP	18	31	241	26,718	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		業種等		
			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	117	192	2,245	248,772	食品・飲料・タバコ		
PACKAGING CORP OF AMERICA	7	14	139	15,494	素材		
ALTRIA GROUP INC	157	255	1,318	146,040	食品・飲料・タバコ		
PINNACLE WEST CAPITAL	8	16	150	16,677	公益事業		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	209	339	3,401	376,827	家庭用品・パーソナル用品		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39	61	766	84,899	銀行		
PFIZER INC	486	787	3,382	374,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34	57	547	60,635	保険		
PULTEGROUP INC	24	35	99	11,065	耐久消費財・アパレル		
PARKER HANNIFIN CORP	11	18	318	35,302	資本財		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14	23	329	36,513	エネルギー		
CITIGROUP INC	212	332	2,133	236,305	銀行		
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22	32	173	19,169	保険		
PPG INDUSTRIES INC	20	32	358	39,739	素材		
PENTAIR PLC	13	18	80	8,880	資本財		
PRAXAIR INC	23	—	—	—	素材		
P G & E CORP	43	—	—	—	公益事業		
PPL CORP	58	98	312	34,570	公益事業		
PROGRESSIVE CORP	48	80	584	64,697	保険		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42	67	388	43,043	公益事業		
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14	22	267	29,686	消費者サービス		
RAYTHEON COMPANY	23	38	721	79,982	資本財		
REPUBLIC SERVICES INC	18	31	242	26,917	商業・専門サービス		
REGIONS FINANCIAL CORP	93	134	218	24,195	銀行		
ROPER TECHNOLOGIES INC	8	13	436	48,315	資本財		
CENTERPOINT ENERGY INC	35	65	206	22,909	公益事業		
ROBERT HALF INTL INC	10	18	127	14,072	商業・専門サービス		
ROCKWELL AUTOMATION INC	10	16	303	33,654	資本財		
SCHLUMBERGER LTD	115	188	835	92,514	エネルギー		
STRYKER CORP	26	41	784	86,884	ヘルスケア機器・サービス		
SCHWAB (CHARLES) CORP	99	160	742	82,203	各種金融		
SEMPRA ENERGY	21	36	429	47,618	公益事業		
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6	11	508	56,331	素材		
STANLEY BLACK & DECKER INC	12	21	292	32,379	資本財		
SUNTRUST BANKS INC	38	60	400	44,312	銀行		
TRAVELERS COS INC/THE	22	35	462	51,264	保険		
SOUTHERN CO/THE	84	139	702	77,868	公益事業		
AT&T INC	604	990	3,085	341,811	電気通信サービス		
WESTERN DIGITAL CORP	24	42	210	23,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
STATE STREET CORP	30	50	368	40,832	各種金融		
SYSCO CORP	39	63	426	47,259	食品・生活必需品小売り		
SEALED AIR CORP	12	18	80	8,895	素材		
SCANA CORP	12	—	—	—	公益事業		
TEXAS INSTRUMENTS INC	81	131	1,406	155,813	半導体・半導体製造装置		
TIFFANY & CO	7	15	140	15,619	小売		
TORCHMARK CORP	8	14	122	13,570	保険		
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	77	122	439	48,692	資本財		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33	54	1,382	153,127	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
TEXTRON INC	21	35	196	21,781	資本財		
UNION PACIFIC CORP	64	100	1,708	189,259	運輸		
UNUM GROUP	18	25	96	10,726	保険		
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61	110	1,410	156,278	資本財		

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		業種等		
			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			
UNITEDHEALTH GROUP INC	79	131	3,499	387,664			ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	129	206	1,060	117,524			銀行
MARATHON OIL CORP	71	113	191	21,203			エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	57	94	1,047	116,058			運輸
VALERO ENERGY CORP	35	59	508	56,370			エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7	11	158	17,565			ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	28	46	242	26,896			メディア・娯楽
VF CORP	27	43	376	41,741			耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	11	19	215	23,829			素材
WILLIAMS COS INC	98	160	434	48,133			エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70	111	785	87,049			食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	26	43	330	36,567			公益事業
WALMART INC	120	194	1,931	214,012			食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	6	191	21,178			ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	365	576	2,827	313,254			銀行
WASTE MANAGEMENT INC	33	54	543	60,167			商業・専門サービス
WATERS CORP	6	10	248	27,565			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	5	9	135	14,966			耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	14	32	103	11,490			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	42	68	381	42,235			公益事業
KEYCORP	88	145	257	28,490			銀行
CARMAX INC	14	22	136	15,156			小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16	27	345	38,323			ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	26	41	395	43,864			消費者サービス
TJX COMPANIES INC	52	170	859	95,229			小売
CA INC	26	—	—	—			ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	10	17	286	31,714			家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	—	17	179	19,858			素材
CADENCE DESIGN SYS INC	23	41	232	25,750			ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	33	54	320	35,480			消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27	46	492	54,571			ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	32	62	146	16,242			食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	25	42	347	38,544			公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	57	92	256	28,385			銀行
STERICYCLE INC	6	—	—	—			商業・専門サービス
INTEL CORP	387	621	3,264	361,659			半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	391	612	3,070	340,132			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	7	11	225	25,020			商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	9	15	285	31,628			不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	36	59	1,293	143,260			食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	83	129	511	56,706			半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	25	40	389	43,194			メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	24	40	259	28,724			食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	51	88	200	22,205			ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	31	52	495	54,843			小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	19	32	293	32,471			半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	106	173	1,472	163,080			耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	55	86	1,628	180,398			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	14	20	182	20,222			銀行
NORTHERN TRUST CORP	17	30	284	31,537			各種金融
MICROSOFT CORP	639	1,052	11,681	1,294,025			ソフトウェア・サービス
ANYSYS INC	6	12	213	23,599			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	
CENTENE CORP	17	54	350	38,844	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	114	169	1,207	133,770	消費者サービス
ORACLE CORP	248	346	1,819	201,509	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	36	59	2,156	238,879	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6	10	411	45,601	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	63	107	445	49,302	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15	24	204	22,661	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	12	18	112	12,450	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10	15	149	16,544	小売
LAM RESEARCH CORP	13	20	374	41,494	半導体・半導体製造装置
COPART INC	16	26	157	17,396	商業・専門サービス
WYNN RESORTS LTD	7	13	174	19,324	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	382	617	2,385	264,289	メディア・娯楽
XILINX INC	21	33	415	45,989	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	29	47	333	36,915	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	20	28	116	12,940	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	6	10	260	28,812	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	108	176	1,158	128,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	10	18	197	21,825	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	9	15	842	93,353	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	20	34	872	96,657	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	4	6	161	17,945	銀行
PAYCHEX INC	26	43	330	36,646	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	18	29	470	52,101	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	58	104	1,680	186,115	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	9	14	64	7,093	小売
ALPHABET INC-CL A	24	40	4,549	504,047	メディア・娯楽
GARMIN LTD	9	15	129	14,309	耐久消費財・アパレル
QUALCOMM INC	123	167	891	98,738	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	22	34	161	17,921	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	12	21	220	24,399	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	—	39	222	24,677	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	33	55	9,131	1,011,625	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	20	33	323	35,866	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	11	20	178	19,754	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	12	21	250	27,700	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	22	31	155	17,277	各種金融
CERNER CORP	26	42	244	27,103	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	8	15	269	29,848	ソフトウェア・サービス
EBAY INC	76	120	451	50,003	小売
NVIDIA CORP	50	83	1,323	146,635	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	19	32	314	34,876	小売
BOOKING HOLDINGS INC	4	6	1,209	133,972	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	160	264	5,350	592,718	各種金融
BB&T CORP	65	107	552	61,238	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84	123	658	72,988	各種金融
BORGWARNER INC	14	26	111	12,383	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	20	34	86	9,602	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	9	14	147	16,302	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	13	22	196	21,733	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	5	8	84	9,368	保険
AETNA INC	27	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMEREN CORPORATION	20	34	250	27,802	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	40	68	560	62,066	公益事業
AON PLC	20	33	575	63,777	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	46	75	319	35,364	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	21	33	193	21,415	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	29	48	133	14,739	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RED HAT INC	14	23	428	47,434	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	5	8	141	15,650	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	20	32	107	11,878	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	14	22	156	17,351	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	22	35	235	26,087	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	14	22	192	21,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	17	27	901	99,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	12	20	604	67,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	40	66	1,720	190,642	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21	34	647	71,695	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELGENE CORP	58	96	861	95,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48	80	579	64,202	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	46	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	14	21	165	18,347	運輸
FASTENAL CO	24	36	229	25,405	資本財
FISERV INC	34	52	450	49,876	ソフトウェア・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	13	25	101	11,273	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE INC	409	614	10,621	1,176,695	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12	18	162	17,954	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	92	144	207	23,000	銀行
ZIONS BANCORP NA	16	28	144	16,059	銀行
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18	29	388	43,028	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	10	17	158	17,528	運輸
CENTURYLINK INC	81	140	188	20,908	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	11	17	89	9,935	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	42	74	233	25,896	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	34	55	375	41,608	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	23	34	161	17,940	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANCE AUTO PARTS INC	6	9	149	16,528	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	31	54	153	17,046	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13	22	374	41,521	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO	18	—	—	—	エネルギー
COOPER COS INC/THE	4	7	209	23,175	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	20	—	—	—	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	25	40	381	42,284	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVERY INC - A	15	16	48	5,407	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	34	54	316	35,114	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	10	15	202	22,394	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21	31	138	15,324	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12	19	265	29,408	各種金融
ANDEAVOR	11	—	—	—	エネルギー
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	48	78	587	65,070	各種金融
NASDAQ INC	9	15	141	15,722	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15	25	55	6,100	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	29	47	137	15,253	メディア・娯楽
CBRE GROUP INC - A	24	45	232	25,719	不動産

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	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2	3	189	20,945	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	21	19	97	10,793	食品・飲料・タバコ
CUMMINS INC	12	20	314	34,852	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9	15	114	12,668	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	24	39	79	8,858	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5	8	156	17,301	素材
CIMAREX ENERGY CO	7	14	108	12,006	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	4	7	92	10,223	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	19	30	138	15,353	公益事業
HANESBRANDS INC	27	40	77	8,582	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	76	123	2,761	305,902	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	36	65	117	13,008	ソフトウェア・サービス
IPG PHOTONICS CORP	3	5	89	9,877	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	29	44	142	15,779	素材
TRANSDIGM GROUP INC	4	6	294	32,620	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	9	14	146	16,265	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10	18	310	34,419	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	24	57	102	11,352	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	29	45	382	42,391	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29	45	327	36,225	各種金融
LOEWS CORP	21	34	164	18,201	保険
ULTA BEAUTY INC	4	7	226	25,058	小売
LKQ CORP	25	44	122	13,612	小売
HORMEL FOODS CORP	22	40	174	19,309	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	11	18	156	17,354	素材
HARRIS CORP	9	16	271	30,100	資本財
HUMANA INC	11	18	583	64,598	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	24	37	156	17,347	公益事業
INVESCO LTD	32	58	111	12,324	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13	21	205	22,764	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	15	27	288	31,963	エネルギー
MSCI INC	7	12	223	24,787	各種金融
MOLSON COORS BREWING CO -B	15	23	146	16,280	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	129	211	1,845	204,394	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	148	239	3,488	386,502	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	37	58	140	15,603	エネルギー
FLOWSERVE CORP	10	14	68	7,638	資本財
HELMERICH & PAYNE	8	12	67	7,472	エネルギー
DISCOVERY INC-C	26	52	143	15,874	メディア・娯楽
RESMED INC	11	18	183	20,299	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	7	13	190	21,155	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	19	32	259	28,780	資本財
CHURCH & DWIGHT CO INC	20	35	237	26,330	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7	12	134	14,891	運輸
PERRIGO CO PLC	10	13	67	7,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	12	20	76	8,450	資本財
FMC CORP	11	17	158	17,521	素材
EVERSOURCE ENERGY	26	43	305	33,877	公益事業
ALLERGAN PLC	28	42	587	65,072	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DELTA AIR LINES INC	53	83	428	47,428	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14	25	258	28,592	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	12	23	293	32,521	商業・専門サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DOLLAR GENERAL CORP	21	34	412	45,702	小売
FORTINET INC	—	18	158	17,604	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	19	31	284	31,524	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2	3	224	24,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	105	176	707	78,328	自動車・自動車部品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26	41	373	41,375	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3	6	138	15,320	資本財
HCA HEALTHCARE INC	23	37	536	59,470	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	14	23	131	14,588	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	38	94	613	67,981	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	—	15	153	16,971	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	13	21	105	11,700	資本財
XYLEM INC	14	26	198	21,983	資本財
ABIOMED INC	3	6	228	25,311	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	7	15	86	9,598	メディア・娯楽
FIRST REPUBLIC BANK/CA	—	23	244	27,138	銀行
REGENERON PHARMACEUTICALS	6	10	433	48,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	34	58	570	63,235	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	199	327	5,296	586,734	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	22	40	221	24,569	公益事業
ALBEMARLE CORP	9	15	140	15,559	素材
PVH CORP	6	9	108	12,013	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	157	250	483	53,530	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	30	53	140	15,509	商業・専門サービス
APTIV PLC	22	36	300	33,292	自動車・自動車部品
ABBVIE INC	126	204	1,639	181,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10	17	146	16,199	各種金融
ZOETIS INC	40	65	622	68,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	30	49	64	7,143	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS B	7	30	40	4,432	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	4	6	107	11,939	資本財
PERKINELMER INC	9	15	142	15,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAPRI HOLDINGS LTD	12	18	81	9,076	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	54	98	312	34,587	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	10	136	15,096	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7	11	152	16,924	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7	12	283	31,429	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	8	11	103	11,457	資本財
ALPHABET INC-CL C	25	41	4,648	514,906	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	6	11	162	18,054	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	34	55	198	21,938	運輸
IQVIA HOLDINGS INC	13	21	309	34,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23	40	344	38,149	消費者サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	20	210	23,348	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	—	24	199	22,079	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9	14	121	13,513	メディア・娯楽
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	16	27	152	16,892	消費者サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	59	91	291	32,282	各種金融
QORVO INC	10	14	99	10,973	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15	25	201	22,340	保険
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40	60	223	24,762	銀行
WESTROCK CO	21	33	133	14,756	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		
KRAFT HEINZ CO/THE	49	82	288	31,961	食品・飲料・タバコ	
PAYPAL HOLDINGS INC	92	160	1,540	170,611	ソフトウェア・サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	127	195	319	35,381	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ARISTA NETWORKS INC	—	6	181	20,134	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15	34	67	7,465	耐久消費財・アパレル	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	15	23	828	91,835	メディア・娯楽	
IDEXX LABORATORIES INC	7	12	251	27,830	ヘルスケア機器・サービス	
SMITH (A. O.) CORP	10	20	107	11,882	資本財	
FORTIVE CORP	25	40	327	36,264	資本財	
IHS MARKIT LTD	29	49	264	29,282	商業・専門サービス	
XL GROUP LTD	21	—	—	—	保険	
COTY INC-CL A	46	61	69	7,680	家庭用品・パーソナル用品	
ARCONIC INC	31	50	93	10,325	資本財	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	18	133	14,737	食品・飲料・タバコ	
TELEFLEX INC	—	6	194	21,532	ヘルスケア機器・サービス	
ENVISION HEALTHCARE CORP	11	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
TECHNIPFMC PLC	36	58	132	14,677	エネルギー	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9	14	137	15,195	各種金融	
DXC TECHNOLOGY CO	23	36	244	27,135	ソフトウェア・サービス	
ROLLINS INC	—	18	73	8,163	商業・専門サービス	
BAKER HUGHES A GE CO	34	75	199	22,082	エネルギー	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	8	13	58	6,504	保険	
DOWDUPONT INC	193	312	1,716	190,104	素材	
BROADCOM INC	33	56	1,558	172,634	半導体・半導体製造装置	
EVERGY INC	22	34	189	21,004	公益事業	
LINDE PLC	—	75	1,301	144,210	素材	
CIGNA CORP	—	51	1,007	111,579	ヘルスケア機器・サービス	
合計	株数・金額	23,484	38,065	310,463	34,393,144	
	銘柄数<比率>	474	475	—	<94.4%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HCP INC	3	6	201	22,342	0.1
MACERICH CO/THE	1	1	50	5,623	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.864	1	201	22,279	0.1
PROLOGIS INC	5	8	620	68,716	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	2	335	37,121	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.553	0.93	261	28,998	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	1	150	16,697	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.577	0.958	129	14,344	0.0
WELLTOWER INC	3	5	378	41,945	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	1	2	290	32,163	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.855	1	153	16,994	0.0
REALTY INCOME CORP	2	4	284	31,482	0.1
REGENCY CENTERS CORP	1	2	150	16,676	0.0
SL GREEN REALTY CORP	0.716	1	121	13,502	0.0
UDR INC	2	3	155	17,242	0.0
VENTAS INC	2	4	312	34,605	0.1
WEYERHAEUSER CO	6	10	280	31,070	0.1
AMERICAN TOWER CORP	3	6	1,060	117,441	0.3
DUKE REALTY CORP	2	4	144	16,010	0.0
IRON MOUNTAIN INC	2	4	145	16,164	0.0
EQUINIX INC	0.662	1	457	50,701	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	3	5	677	75,054	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	3	4	368	40,819	0.1
GGP INC	7	—	—	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	6	10	205	22,750	0.1
PUBLIC STORAGE	1	1	400	44,319	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	2	4	760	84,238	0.2
VORNADO REALTY TRUST	1	2	152	16,843	0.0
KIMCO REALTY CORP	3	6	116	12,933	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	1	365	40,437	0.1
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	1	2	115	12,771	0.0
合 計	口 数	口 数	金 額	金 額	
	76	115	9,047	1,002,293	
銘 柄 数 < 比 率 >	31	30	—	< 2.8% >	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	百万円	百万円
	SP EMINI	1,097	—

(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2月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	34,393,144	94.3
投資証券	1,002,293	2.7
コール・ローン等、その他	1,072,679	3.0
投資信託財産総額	36,468,116	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (36,413,475千円) の投資信託財産総額 (36,468,116千円) に対する比率は99.9%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=110.78円		
------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年2月25日現在)

○損益の状況 (2018年8月28日～2019年2月25日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	36,535,645,477
コール・ローン等	659,167,213
株式(評価額)	34,393,144,478
投資証券(評価額)	1,002,293,534
未収入金	90,792,231
未取配当金	48,903,402
差入委託証拠金	341,344,619
(B) 負債	98,664,348
未払金	67,567,260
未払解約金	31,097,000
未払利息	88
(C) 純資産総額(A-B)	36,436,981,129
元本	19,719,259,582
次期繰越損益金	16,717,721,547
(D) 受益権総口数	19,719,259,582口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,478円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	259,095,152
受取配当金	252,446,447
受取利息	6,677,687
その他収益金	52,319
支払利息	△ 81,301
(B) 有価証券売買損益	239,777,490
売買益	1,663,455,117
売買損	△ 1,423,677,627
(C) 先物取引等取引損益	48,599,508
取引益	226,188,721
取引損	△ 177,589,213
(D) 保管費用等	△ 8,216,927
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	539,255,223
(F) 前期繰越損益金	13,452,561,505
(G) 追加信託差損益金	9,061,512,205
(H) 解約差損益金	△ 6,335,607,386
(I) 計(E+F+G+H)	16,717,721,547
次期繰越損益金(I)	16,717,721,547

<注記事項>

- ①期首元本額 15,058,261,426円
 期中追加設定元本額 11,510,331,722円
 期中一部解約元本額 6,849,333,566円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.8478円です。

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

eMAXIS Slim 米国株式(S&P500)	6,863,244,854円
MUAM S&P500インデックスファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	12,856,014,728円
合計	19,719,259,582円

(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。