

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	2024年5月10日まで（2014年6月27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、日本を除く先進国の株式に実質的な投資を行い、MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。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。ただし、市況動向等により、一時的に組入比率の調整を行う場合があります。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等に直接投資することがあります。
	マザーファンド	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※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。
 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）

ヘッジ付先進国株式 インデックスオープン

第2期（決算日：2016年5月12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「ヘッジ付先進国株式インデックスオープン」は、去る5月12日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(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、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

ヘッジ付先進国株式インデックスオープンのご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	7
◇1万口当たりの費用明細	8
◇売買及び取引の状況	9
◇株式売買比率	9
◇利害関係人との取引状況等	9
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	10
◇組入資産の明細	10
◇投資信託財産の構成	11
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	12
◇損益の状況	12
◇お知らせ	13

マザーファンドのご報告

◇ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	14
------------------------	----

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰				
(設定日)	円								百万円
2014年6月27日	10,000		—	—	302.46	—	—	—	200
1期(2015年5月12日)	10,915		0	9.2	325.42	7.6	90.2	8.1	218
2期(2016年5月12日)	10,374		0	△5.0	303.60	△6.7	86.8	11.5	1,421

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス) (円ヘッジ・円ベース) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円ヘッジ・円ベース) に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		M S C I K o k u s a i I n d e x (M S C I コ ク サ イ イ ン デ ッ ク ス) (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
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2015年5月12日	10,915	—	325.42	—	90.2	8.1	2.1
5月末	11,027	1.0	328.08	0.8	91.3	9.1	2.1
6月末	10,625	△ 2.7	315.61	△ 3.0	87.6	9.6	2.0
7月末	10,883	△ 0.3	323.09	△ 0.7	89.7	8.0	2.1
8月末	10,240	△ 6.2	303.65	△ 6.7	78.6	15.5	2.0
9月末	9,686	△ 11.3	286.20	△ 12.1	83.6	10.8	2.2
10月末	10,666	△ 2.3	315.38	△ 3.1	88.6	7.9	2.3
11月末	10,704	△ 1.9	315.99	△ 2.9	91.0	5.9	2.3
12月末	10,578	△ 3.1	312.08	△ 4.1	85.3	10.1	2.2
2016年1月末	9,673	△ 11.4	285.22	△ 12.4	83.7	13.6	2.3
2月末	9,861	△ 9.7	289.87	△ 10.9	80.0	11.8	2.2
3月末	10,369	△ 5.0	304.29	△ 6.5	86.6	11.5	2.4
4月末	10,558	△ 3.3	309.60	△ 4.9	87.8	7.1	2.4
(期 末) 2016年5月12日	10,374	△ 5.0	303.60	△ 6.7	86.8	11.5	2.5

(注) 騰落率は期首比。

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

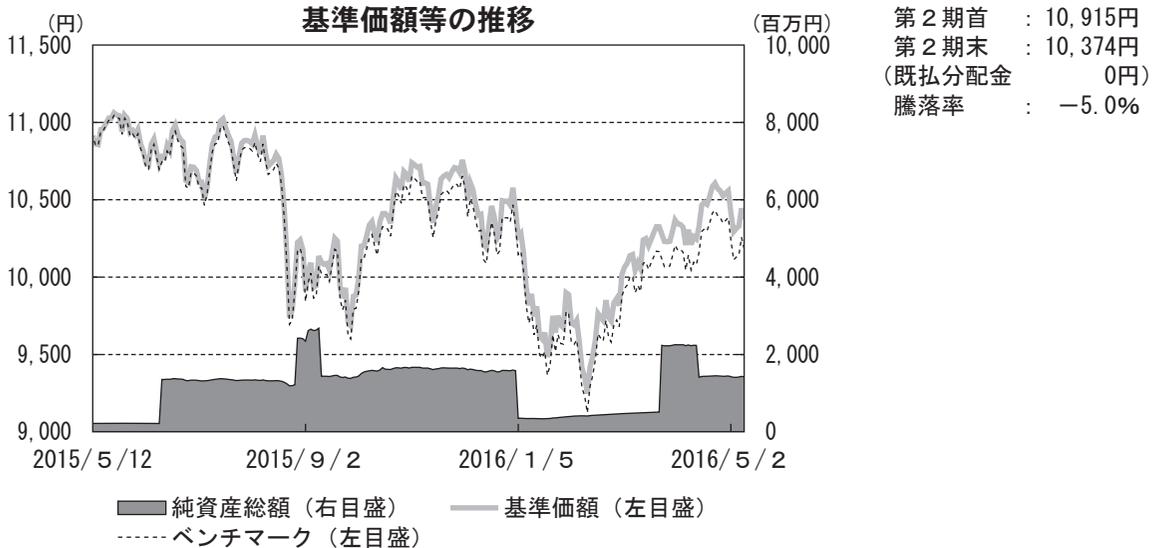
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第2期：2015/5/13～2016/5/12)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ5.0%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（-6.7%）を1.7%上回りました。



基準価額の変動要因

下落要因	米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから外国株式市況が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。
------	--

投資環境について

(第2期：2015/5/13~2016/5/12)

◎外国株式市況

- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜ヘッジ付先進国株式インデックスオープン＞

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

＜ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ4.6%の下落となりました。

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

〈ヘッジ付先進国株式インデックスオープン〉
ベンチマークとのカイ離は1.7%程度となりました。

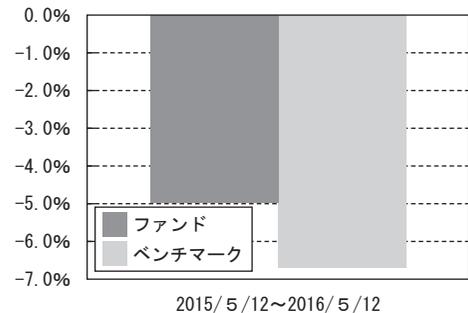
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.4%程度	2.1%程度	1.7%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

〈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△0.4%程度
でした。

〈マザーファンド保有による要因〉
マザーファンド保有による影響は2.1%程度で
した。

基準価額 (ペビファンド) とベンチマークの対比 (騰落率)



〈ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド〉
ベンチマークは6.7%の下落となったため、カイ離は2.1%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	△0.1%程度	2.2%程度	2.1%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・REITを含む）に投資しました。
- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、

- ・ 売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
- ・ ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は 2.2% 程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計	2.4%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料・為替ヘッジ効果等	計	$\Delta 0.2\%$ 程度

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

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第2期
	2015年5月13日～2016年5月12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	1,153

(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

<ヘッジ付先進国株式インデックスオープン>

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

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド>

- ・引き続きファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・REITを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(45)	(0.432)	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)	(0.054)	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)	(6)	(0.054)	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	0.013	(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)	(0.006)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(1)	(0.007)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.018	(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)	(0.017)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	7	0.071	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(7)	(0.066)	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)	(0.002)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	66	0.642	
期中の平均基準価額は、10,405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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

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 336	百万円 322	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。

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 3,383,522	千円 4,446,000	千口 2,480,386	千円 3,262,400

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016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	
	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	40,347,650千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	73,386,603千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.54	

(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

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

<ヘッジ付先進国株式インデックスオープン>

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	940,696	685,345	72.9	940,909	697,331	74.1
為替直物取引	20,282	17,371	85.6	17,479	13,209	75.6

平均保有割合 1.6%

※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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 200	百万円 -	百万円 50	百万円 150	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期		末
	買 建 額	売 建 額	額
外国 株式先物取引	百万円 22		百万円 -

(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。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期	
	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 147,945	千口 1,051,081	千円 1,396,046

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	1,396,046 千円	97.7 %
コール・ローン等、その他	32,619	2.3
投資信託財産総額	1,428,665	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（82,826,860千円）の投資信託財産総額（88,477,594千円）に対する比率は93.6%です。

(注) 期末における外貨建純資産（1,718千円）の投資信託財産総額（1,428,665千円）に対する比率は0.1%です。

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

1 アメリカドル=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 ユーロ=123.81円	1 イギリスポンド=156.52円
1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=79.91円	1 ニュージーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円
1 イスラエルシェケル=28.84円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	1,428,665,639
コール・ローン等	19,901,645
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,396,046,020
未収入金	529,929
差入委託証拠金	12,188,045
(B) 負債	7,112,566
未払解約金	4,051,430
未払信託報酬	3,042,264
未払利息	40
その他未払費用	18,832
(C) 純資産総額(A-B)	1,421,553,073
元本	1,370,275,180
次期繰越損益金	51,277,893
(D) 受益権総口数	1,370,275,180口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,374円

<注記事項>

- ①期首元本額 200,000,000円
 期中追加設定元本額 4,656,075,284円
 期中一部解約元本額 3,485,800,104円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0374円です。

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	6,960
受取利息	24,388
支払利息	△ 17,428
(B) 有価証券売買損益	17,637,815
売買益	37,531,999
売買損	△ 19,894,184
(C) 先物取引等取引損益	784,728
取引益	4,385,851
取引損	△ 3,601,123
(D) 信託報酬等	△ 6,545,783
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	11,883,720
(F) 前期繰越損益金	1,133,963
(G) 追加信託差損益金	38,260,210
(配当等相当額)	(124,232,765)
(売買損益相当額)	(△ 85,972,555)
(H) 計(E+F+G)	51,277,893
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	51,277,893
追加信託差損益金	38,260,210
(配当等相当額)	(133,416,100)
(売買損益相当額)	(△ 95,155,890)
分配準備積立金	24,601,434
繰越損益金	△ 11,583,751

(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) (D)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) (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。

②分配金の計算過程

項目	2015年5月13日～ 2016年5月12日
費用控除後の配当等収益額	23,467,471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	133,416,100円
分配準備積立金額	1,133,963円
当ファンドの分配対象収益額	158,017,534円
1万口当たり収益分配対象額	1,153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 (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

《第9期》決算日2016年5月12日

〔計算期間：2015年5月13日～2016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9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9期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をMSCI Kokusai Index (円ヘッジ・円ベース) の動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率 (組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。) は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。
主要運用対象	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
5期(2012年5月14日)	8,628	△ 3.2	216.07	△ 5.7	91.6	5.4	2.0	160,031
6期(2013年5月13日)	10,714	24.2	261.46	21.0	97.8	3.6	2.4	175,865
7期(2014年5月12日)	12,301	14.8	294.15	12.5	92.9	4.5	2.0	153,665
8期(2015年5月12日)	13,927	13.2	325.42	10.6	95.5	2.4	2.2	91,128
9期(2016年5月12日)	13,282	△ 4.6	303.60	△ 6.7	88.4	10.2	2.5	87,141

(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円ヘッジ・円ベース) に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

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

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		M S C I K o k u s a i I n d e x (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	(円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率				
(期 首) 2015年5月12日	円	%		%	%	%	%
	13,927	—	325.42	—	95.5	2.4	2.2
5月末	14,071	1.0	328.08	0.8	96.7	3.4	2.2
6月末	13,558	△ 2.6	315.61	△ 3.0	92.9	4.0	2.1
7月末	13,893	△ 0.2	323.09	△ 0.7	94.5	3.1	2.2
8月末	13,090	△ 6.0	303.65	△ 6.7	85.7	10.0	2.1
9月末	12,367	△11.2	286.20	△12.1	90.0	6.4	2.4
10月末	13,640	△ 2.1	315.38	△ 3.1	93.8	3.6	2.4
11月末	13,694	△ 1.7	315.99	△ 2.9	96.5	1.3	2.5
12月末	13,539	△ 2.8	312.08	△ 4.1	90.1	5.7	2.4
2016年1月末	12,372	△11.2	285.22	△12.4	89.5	8.1	2.4
2月末	12,609	△ 9.5	289.87	△10.9	84.3	7.4	2.3
3月末	13,264	△ 4.8	304.29	△ 6.5	87.9	10.6	2.5
4月末	13,516	△ 3.0	309.60	△ 4.9	89.6	5.6	2.5
(期 末) 2016年5月12日	13,282	△ 4.6	303.60	△ 6.7	88.4	10.2	2.5

(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4.6%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(−6.7%)を2.1%上回りました。

基準価額の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.7%の下落となったため、カイ離は2.1%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	△0.1%程度	2.2%程度	2.1%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式 (先物・REITを含む) に投資しました。
- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、

- ・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
- ・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.2%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計 2.4%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料・為替ヘッジ効果等	計△0.2%程度

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

◎今後の運用方針

- ・引き続きファンドの資産のほぼ全額を株式 (先物・REITを含む) に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016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)	(1)	(0.010)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.015	(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)	(0.015)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.067	(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)	(9)	(0.066)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	12	0.092	
期中の平均基準価額は、13,301円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 5,965 (1,773)	千オーストラリアドル 7,349 (104)	百株 4,101 (166)	千オーストラリアドル 5,116 (149)
	ニュージーランド	169	千ニュージーランドドル 77	196	千ニュージーランドドル 88
	香港	6,483 (1,130)	千香港ドル 17,674 (-)	4,319 (480)	千香港ドル 15,233 (-)
	シンガポール	3,459 (2)	千シンガポールドドル 1,242 (-)	2,556	千シンガポールドドル 991
	イスラエル	409	千イスラエルシケル 2,226	295	千イスラエルシケル 1,476

(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	101	2	82
MACERICH CO/THE	0.86	68	0.798	63
PROLOGIS INC	3	155	2	91
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.621	49	0.506	38
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	93	0.599	40
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.423	96	0.272	60
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	233	0.209	15
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.449	67	0.305	42
WELLTOWER INC	2	156	1	107
BOSTON PROPERTIES INC	0.991	122	0.75	94
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	174	—	—
REALTY INCOME CORP	2	114	0.98	46
REGENCY CENTERS CORP	0.578	41	0.36	22
SL GREEN REALTY CORP	0.682	67	0.435	50
UDR INC	1	63	1	36
VENTAS INC	2	131	1	87
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5	58	4	43
RAYONIER INC	—	—	3	80
WEYERHAEUSER CO	4 (5)	134 (148)	2	83
AMERICAN TOWER CORP	2	276	2	191
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	2	44	2	39
VEREIT INC	5	46	3	31
DUKE REALTY CORP	2	44	1	26
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4	116	0.215	5
IRON MOUNTAIN INC	1	59	0.694	21
EQUINIX INC	0.57 (0.032)	179 (9)	0.226	62
COMMUNICATIONS SALES & LE	0.264	5	3	66
CROWN CASTLE INTL CORP	2 (7)	180 (590)	0.883	73
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (1)	— (—)	1	51
EQUITY RESIDENTIAL	2	171	1	97
GENERAL GROWTH PROPERTIES	3	103	1	46
HOST HOTELS & RESORTS INC	4	76	3	67
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.92	29	0.585	20
PLUM CREEK TIMBER CO	0.187 (△ 3)	7 (△ 148)	0.706	30
PUBLIC STORAGE	0.938	241	0.715	150
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	385	1	272
VORNADO REALTY TRUST	1	105	0.883	86
KIMCO REALTY CORP	2	70	1	47

銘	柄	買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ		千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	AVALONBAY COMMUNITIES INC		0.938	170	0.605	103
	小 計		77 (10)	4,244 (600)	53	2,579
	カナダ			千カナダドル		千カナダドル
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT		1	51	—	—
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		0.6	12	0.4	9
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1	29	0.9	24
	小 計		3	93	1	33
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
	フランス					
	GECINA SA		0.32	37	0.101	11
	KLEPIERRE		2	99	1	43
	UNIBAIL-RODAMCO SE		0.633	149	0.473	112
	FONCIERE DES REGIONS		0.236	18	0.188	15
	ICADE		0.272	18	0.295	20
	小 計		3	324	2	201
	ユ ー ロ 計		3	324	2	201
	イギリス			千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC		2	17	4	38
	HAMMERSON PLC		5	30	4	26
	LAND SECURITIES GROUP PLC		5	57	3	49
	INTU PROPERTIES PLC		6	19	4	15
	SEGRO PLC		4	19	4	17
	小 計		23	144	21	147
	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		24	74	11	32
	SCENTRE GROUP		34	146	25	101
	FEDERATION CENTRES		— (40)	— (122)	—	—
	NOVION PROPERTY GROUP		— (△ 48)	— (△ 122)	—	—
	GPT GROUP		13	66	6	30
	MIRVAC GROUP		18	35	10	20
	STOCKLAND		17	70	10	42
	WESTFIELD CORP		12	118	8	84
	DEXUS PROPERTY GROUP		7	57	4	33
	GOODMAN GROUP		12	78	7	45
	小 計		140 (△ 8)	646 (—)	85	391
	香港			千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT		15	699	12	547
	小 計		15	699	12	547
	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		19 (—)	30 (△0.49129)	18 (—)	31 (0.00001)	

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
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	15	21	13	18
	CAPITALAND MALL TRUST	16	34	14	29
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	14 (-)	36 (△0.07347)	12	28
小計		65 (-)	123 (△0.56476)	58 (-)	109 (0.00001)

(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 68,161	百万円 61,176	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

(2015年5月13日～2016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	40,347,650千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	73,386,603千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.54

(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

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 940,696	百万円 685,345	72.9	百万円 940,909	百万円 697,331	74.1
為替直物取引	20,282	17,371	85.6	17,479	13,209	75.6

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC	277	327	312	33,882	素材
AMERICAN EXPRESS CO	218	209	1,352	146,579	各種金融
AVON PRODUCTS INC	105	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	353	373	1,418	153,775	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	78	82	352	38,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13	13	223	24,272	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	113	115	999	108,341	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	17	18	84	9,190	小売
AES CORP	163	170	193	20,952	公益事業
AFLAC INC	105	106	733	79,477	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329	309	1,731	187,638	保険
APACHE CORP	88	94	511	55,387	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	15	15	313	33,990	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	147	156	1,812	196,462	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	50	51	729	79,037	素材
ANTHEM INC	63	65	907	98,313	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	119	127	609	66,087	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	311	336	742	80,485	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	127	136	635	68,853	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	159	159	2,118	229,602	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	49	52	881	95,512	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	69	77	244	26,484	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	390	417	2,956	320,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	31	30	1,088	117,944	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	975	1,018	5,209	564,522	電気通信サービス
CR BARD INC	17	18	405	43,974	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	30	27	195	21,207	素材
BAKER HUGHES INC	105	91	408	44,287	エネルギー
ALLSTATE CORP	98	96	652	70,658	保険
EVERETT DENNISON CORP	20	22	172	18,712	素材
CHUBB LTD	77	115	1,426	154,544	保険
ANALOG DEVICES INC	74	78	435	47,166	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	7	7	586	63,609	小売
CVS HEALTH CORP	269	277	2,886	312,762	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	53	53	291	31,594	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	301	296	558	60,540	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	879	921	5,694	617,112	銀行
CIGNA CORP	61	64	835	90,517	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	135	145	1,055	114,410	資本財
COCA-COLA CO/THE	926	1,033	4,700	509,385	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	130	133	936	101,435	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	47	46	304	32,958	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	234	244	632	68,543	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	45	50	174	18,865	メディア
CHEVRON CORP	444	471	4,765	516,416	エネルギー
COACH INC	64	69	265	28,735	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROCKWELL COLLINS INC	28	32	297	32,241	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	289	309	1,349	146,291	エネルギー
CME GROUP INC	75	80	752	81,511	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	77	82	633	68,639	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	214	213	1,534	166,329	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	137	149	1,074	116,475	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	277	281	1,442	156,294	素材
DEVON ENERGY CORP	91	115	374	40,560	エネルギー
DEERE & CO	80	78	655	71,010	資本財
DANAHER CORP	148	154	1,510	163,688	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	213	219	1,410	152,878	素材
WALT DISNEY CO/THE	378	393	4,020	435,724	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	31	28	181	19,665	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	166	172	1,392	150,894	公益事業
DR HORTON INC	75	84	246	26,716	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	21	22	94	10,213	小売
TARGET CORP	142	146	1,108	120,084	小売
DUN & BRADSTREET CORP	8	9	108	11,744	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	16	—	—	—	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	40	42	322	35,002	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	38	38	256	27,765	資本財
DTE ENERGY COMPANY	41	45	413	44,806	公益事業
EXXON MOBIL CORP	995	1,042	9,255	1,003,039	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25	53	567	61,481	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	128	137	1,104	119,744	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	162	163	865	93,814	資本財
EXELON CORP	202	231	816	88,468	公益事業
ECOLAB INC	63	66	775	84,032	素材
EQUIFAX INC	28	29	362	39,232	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	55	—	—	—	エネルギー
EMC CORP/MA	478	485	1,316	142,711	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	54	55	528	57,219	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	111	115	718	77,812	資本財
EDISON INTERNATIONAL	73	82	591	64,142	公益事業
ENTERGY CORP	42	45	347	37,615	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	10	10	195	21,210	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	14	15	117	12,737	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	103	115	1,385	150,163	公益事業
MACY'S INC	81	78	246	26,746	小売
FEDEX CORP	63	67	1,083	117,458	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	53	57	160	17,382	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	24	—	—	—	小売
FORD MOTOR CO	844	927	1,234	133,821	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	95	97	348	37,766	各種金融
FOOT LOCKER INC	34	34	204	22,157	小売
FIRSTENERGY CORP	99	106	363	39,355	公益事業
FLUOR CORP	36	35	182	19,808	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	244	289	336	36,419	素材
GENERAL MILLS INC	141	149	957	103,718	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	66	67	973	105,550	資本財
WW GRAINGER INC	14	14	326	35,384	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	
GENERAL ELECTRIC CO	2,361	2,362	7,168	776,839	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	—	32	239	25,967	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	36	37	362	39,239	小売
TEGNA INC	—	52	122	13,235	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	67	188	20,399	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	55	60	112	12,197	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	92	96	1,532	166,025	各種金融
HALLIBURTON CO	199	210	830	89,983	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	174	183	2,090	226,522	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	50	48	219	23,791	自動車・自動車部品
HP INC	438	450	526	57,033	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	101	102	453	49,115	保険
HERSHEY CO/THE	35	37	342	37,075	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	115	—	—	—	メディア
HOSPIRA INC	39	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARMAN INTERNATIONAL	—	17	131	14,253	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	310	317	4,261	461,801	小売
HASBRO INC	26	28	237	25,704	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	62	65	430	46,677	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	221	230	3,435	372,357	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	94	98	421	45,720	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	87	81	853	92,497	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	96	101	241	26,185	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	20	248	26,900	素材
JOHNSON & JOHNSON	658	692	7,920	858,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	156	162	664	72,019	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	25	27	251	27,249	運輸
KELLOGG CO	62	66	506	54,891	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	88	90	1,169	126,782	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	394	397	1,765	191,348	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	109	231	803	87,045	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	48	48	188	20,395	小売
ELI LILLY & CO	235	249	1,904	206,412	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	23	25	321	34,787	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	39	41	174	18,956	運輸
LENNAR CORP-A	41	44	197	21,444	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	232	229	1,723	186,806	小売
LEGGETT & PLATT INC	32	34	167	18,133	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	58	61	416	45,151	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	94	99	452	49,053	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	63	69	1,673	181,353	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	60	61	265	28,806	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	20	19	266	28,891	資本財
LEGG MASON INC	24	24	74	8,094	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	53	51	354	38,412	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	228	229	2,966	321,434	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	64	67	711	77,080	各種金融
MEDTRONIC PLC	332	353	2,869	310,942	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	670	699	3,797	411,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	252	271	274	29,756	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	80	84	262	28,458	耐久消費財・アパレル
3M CO	143	154	2,615	283,457	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	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	53	39	279	30,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	94	112	248	26,950	消費者サービス
MASCO CORP	82	84	266	28,869	資本財
MONSANTO CO	113	110	994	107,769	素材
MEADWESTVACO CORP	39	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	27	35	415	45,023	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	127	130	834	90,396	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	14	15	309	33,518	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	345	363	958	103,858	各種金融
MCKESSON CORP	54	57	972	105,423	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	226	236	1,026	111,208	保険
MANPOWERGROUP INC	18	18	142	15,394	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	44	44	423	45,878	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	72	74	664	72,017	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,471	2,606	3,700	401,042	銀行
NISOURCE INC	74	—	—	—	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	45	43	928	100,660	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	101	121	180	19,592	銀行
NEWMONT MINING CORP	117	132	448	48,567	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	318	292	860	93,288	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26	29	283	30,729	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	—	3	333	36,132	保険
NUCOR CORP	74	79	379	41,162	素材
NEWELL BRANDS INC	63	112	542	58,804	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	61	—	—	—	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	103	110	326	35,391	メディア
NOBLE ENERGY INC	90	107	390	42,314	エネルギー
PALL CORP	25	—	—	—	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	183	191	1,459	158,199	エネルギー
OMNICARE INC	23	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	58	60	510	55,289	メディア
PEPSICO INC	351	364	3,854	417,706	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	24	160	17,422	素材
ALTRIA GROUP INC	465	490	3,170	343,633	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	26	28	209	22,742	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	635	680	5,592	606,035	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	123	126	1,096	118,801	銀行
PFIZER INC	1,481	1,545	5,123	555,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	107	112	855	92,755	保険
PULTEGROUP INC	77	78	142	15,465	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS LLC	60	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	34	34	384	41,620	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34	40	663	71,898	エネルギー
CITIGROUP INC	711	745	3,315	359,325	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	68	73	311	33,738	保険
PPG INDUSTRIES INC	32	67	723	78,449	素材
PENTAIR PLC	43	45	265	28,806	資本財
PRAXAIR INC	68	71	808	87,632	素材
P G & E CORP	112	120	709	76,908	公益事業
PPL CORP	157	169	656	71,176	公益事業
PROGRESSIVE CORP	130	146	484	52,507	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	119	127	591	64,145	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	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	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	41	35	287	31,148	消費者サービス
SPX CORP	8	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	39	44	330	35,843	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	72	75	984	106,674	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	66	60	295	31,975	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	320	325	300	32,531	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	10	123	13,411	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	25	443	48,113	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	98	104	229	24,908	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	31	33	129	14,041	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	31	33	376	40,789	資本財
SCHLUMBERGER LTD	302	345	2,550	276,366	エネルギー
STRYKER CORP	80	84	943	102,278	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	276	296	824	89,309	各種金融
SEMPRA ENERGY	55	59	627	67,975	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19	19	582	63,116	素材
ST JUDE MEDICAL INC	67	70	535	58,025	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	34	37	422	45,836	資本財
SUNTRUST BANKS INC	122	127	527	57,126	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	77	76	851	92,268	保険
SOUTHERN CO/THE	212	228	1,150	124,659	公益事業
AT&T INC	1,219	1,539	6,031	653,589	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	51	48	178	19,290	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	98	100	609	66,042	各種金融
SYSCO CORP	137	141	709	76,834	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	46	49	230	25,024	素材
SCANA CORP	32	34	242	26,270	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	36	—	—	—	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	248	253	1,462	158,538	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	30	32	213	23,104	小売
TORCHMARK CORP	29	30	180	19,571	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	98	105	406	44,094	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	94	99	1,478	160,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	64	68	261	28,340	資本財
UNION PACIFIC CORP	209	213	1,807	195,841	運輸
UNUM GROUP	57	60	205	22,302	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	203	210	2,142	232,187	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	225	238	3,117	337,812	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	420	437	1,832	198,540	銀行
MARATHON OIL CORP	158	205	256	27,813	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	165	174	1,787	193,661	運輸
VALERO ENERGY CORP	122	120	673	72,982	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	23	24	198	21,532	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	112	108	605	65,652	メディア
VF CORP	81	85	517	56,115	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	30	33	384	41,670	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	16	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	167	178	348	37,739	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	204	217	1,748	189,531	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	53	79	480	52,063	公益事業
WAL-MART STORES INC	379	401	2,663	288,680	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	1,158	1,214	5,960	645,925	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	102	111	684	74,182	商業・専門サービス
WATERS CORP	19	20	275	29,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	179	220	123	13,425	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	18	19	337	36,556	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	256	227	211	22,945	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	71	74	249	27,090	保険
XCEL ENERGY INC	119	128	531	57,623	公益事業
KEYCORP	202	174	208	22,611	銀行
CARMAX INC	50	50	258	28,054	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	39	47	552	59,861	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	40	42	111	12,075	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	102	107	870	94,351	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	163	167	1,239	134,346	小売
CA INC	78	82	246	26,685	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	45	—	—	—	エネルギー
CLOROX COMPANY	30	32	426	46,256	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	35	36	258	28,034	素材
CARNIVAL CORP	90	103	519	56,248	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	66	70	518	56,180	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	55	—	—	—	保険
CONAGRA FOODS INC	99	108	496	53,818	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	69	74	551	59,801	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	192	198	350	38,004	銀行
STERICYCLE INC	19	21	200	21,774	商業・専門サービス
INTEL CORP	1,137	1,181	3,550	384,732	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,203	1,270	3,392	367,685	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	23	22	209	22,712	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	30	31	321	34,860	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	102	109	1,610	174,484	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	286	300	601	65,160	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	73	77	570	61,844	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	71	73	506	54,879	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	162	168	282	30,594	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	49	102	555	60,182	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	47	42	205	22,218	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	160	339	1,934	209,656	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	2	26	2,904	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	178	188	2,911	315,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	42	44	189	20,573	銀行
NORTHERN TRUST CORP	52	54	380	41,286	各種金融
MICROSOFT CORP	1,841	1,899	9,696	1,050,863	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	21	22	191	20,791	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	—	35	203	22,069	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	150	160	136	14,745	小売
STARBUCKS CORP	351	371	2,088	226,360	消費者サービス
ORACLE CORP	834	800	3,174	343,968	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	71	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	84	85	260	28,248	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	13	101	914	99,154	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	23	24	648	70,248	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	118	128	475	51,500	ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	24	—	—	—	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	44	47	308	33,486	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	19	20	355	38,519	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	33	310	33,653	小売
LAM RESEARCH CORP	37	40	302	32,775	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	18	20	189	20,520	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	505	621	3,857	418,019	メディア
XILINX INC	62	64	276	30,000	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	83	88	503	54,591	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	33	60	374	40,550	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	354	360	3,026	327,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	37	38	318	34,470	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	8	9	586	63,601	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	63	62	642	69,590	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	98	—	—	—	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	60	62	103	11,252	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	76	81	423	45,858	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	211	224	838	90,917	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	18	21	96	10,418	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	—	12	169	18,358	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	17	138	14,961	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	53	56	334	36,245	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	58	63	235	25,475	メディア
SALESFORCE.COM INC	140	157	1,196	129,713	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	33	34	156	16,985	小売
ALPHABET INC-CL A	66	72	5,327	577,305	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	23	—	—	—	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	11	123	13,420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	24	26	124	13,495	資本財
GARMIN LTD	27	28	115	12,466	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	61	62	148	16,070	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	390	376	1,962	212,682	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	53	60	205	22,317	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	36	38	187	20,360	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	56	59	264	28,660	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	66	71	258	28,054	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	92	99	7,113	770,917	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	60	62	472	51,174	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	33	35	273	29,632	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	38	32	227	24,707	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	—	73	185	20,115	各種金融
CERNER CORP	72	77	418	45,385	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	—	97	1,398	151,540	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	34	37	142	15,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	26	25	213	23,152	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	67	75	399	43,320	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	127	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WASTE CONNECTIONS INC	—	26	180	19,559	商業・専門サービス
EBAY INC	263	270	641	69,563	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	128	134	485	52,618	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	48	55	440	47,764	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	12	12	1,579	171,123	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	271	296	4,239	459,437	各種金融

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	
BB&T CORP	169	201	684	74,194	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	264	273	1,089	118,089	各種金融
BORGWARNER INC	53	56	190	20,685	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	63	58	114	12,398	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	23	29	383	41,509	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	197	200	1,483	160,779	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	51	48	370	40,196	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	16	16	142	15,428	保険
AETNA INC	82	86	965	104,624	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	57	61	297	32,236	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	115	123	806	87,451	公益事業
AON PLC	63	68	723	78,415	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	151	149	566	61,409	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	23	128	13,958	保険
HESS CORP	63	70	408	44,285	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	78	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	89	87	199	21,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	63	67	193	21,000	各種金融
RED HAT INC	44	45	330	35,802	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	17	17	183	19,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	52	56	267	29,023	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	41	44	226	24,498	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	72	73	170	18,514	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	35	41	296	32,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	88	103	100	10,920	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	55	55	1,491	161,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	33	36	509	55,166	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	111	124	1,199	130,012	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	56	61	514	55,773	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	43	41	181	19,702	小売
CELGENE CORP	187	196	1,971	213,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	26	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	143	152	929	100,764	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	172	169	1,245	135,015	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	45	46	223	24,247	運輸
FASTENAL CO	65	68	318	34,530	資本財
FISERV INC	57	57	602	65,310	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	134	139	167	18,200	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	10	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	575	524	206	22,347	メディア
SANDISK CORP	51	50	380	41,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	1,378	1,395	12,911	1,399,192	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	36	38	261	28,338	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	187	198	198	21,497	銀行
SIGMA-ALDRICH	28	—	—	—	素材
NABORS INDUSTRIES LTD	62	—	—	—	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	46	56	783	84,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	15	15	178	19,333	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	34	36	261	28,351	運輸
CENTURYLINK INC	134	137	388	42,129	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	32	34	105	11,484	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	97	104	414	44,951	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	26	—	—	—	自動車・自動車部品
ONEOK INC	48	52	210	22,845	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	75	214	1,091	118,267	食品・飲料・タバコ
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	121	—	—	—	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	76	74	140	15,192	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	34	35	218	23,636	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	18	271	29,408	小売
CONSOL ENERGY INC	52	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	101	93	303	32,936	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	39	43	706	76,511	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	124	—	—	—	エネルギー
PARTNERRE LTD	10	—	—	—	保険
COOPER COS INC/THE	11	12	188	20,461	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	35	38	268	29,069	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	73	77	433	47,023	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	24	24	138	14,958	保険
OWENS-ILLINOIS INC	40	—	—	—	素材
AGCO CORP	20	17	89	9,692	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34	37	107	11,663	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	33	35	534	57,888	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	23	30	347	37,661	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11	58	172	18,641	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	110	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	150	149	543	58,864	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	43	43	414	44,936	各種金融
TESORO CORP	29	30	234	25,394	エネルギー
FNF GROUP	60	62	209	22,712	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	26	29	767	83,160	各種金融
NASDAQ INC	27	28	182	19,752	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	39	37	140	15,279	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	84	87	352	38,217	メディア
AUTOLIV INC	21	22	274	29,775	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	70	75	220	23,861	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	7	354	38,375	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	15	17	206	22,396	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	28	28	283	30,759	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	105	111	291	31,621	小売
ARROW ELECTRONICS INC	23	23	142	15,424	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	40	42	484	52,463	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	31	30	153	16,636	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	72	81	144	15,697	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13	14	262	28,470	素材
RANGE RESOURCES CORP	39	42	183	19,845	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	89	96	117	12,772	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	20	23	270	29,357	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	14	14	124	13,479	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	26	29	213	23,131	公益事業
OCEANEERING INTL INC	24	24	80	8,774	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	29	29	201	21,803	消費者サービス
HANESBRANDS INC	93	98	263	28,547	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	235	247	2,389	258,910	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	122	126	242	26,262	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	
AERCAP HOLDINGS NV	—	22	88	9,596	資本財
AVNET INC	31	33	130	14,138	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	75	79	207	22,519	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	20	29	3,173	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	158	168	519	56,334	エネルギー
TRANSIGM GROUP INC	11	13	333	36,125	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	37	32	406	44,002	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	73	76	117	12,690	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	95	96	570	61,786	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	106	107	592	64,210	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	24	28	174	18,904	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	—	13	145	15,762	資本財
PRECISION CASTPARTS CORP	33	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	19	19	110	11,977	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	79	70	281	30,465	保険
TIME WARNER CABLE	66	70	1,535	166,438	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	14	15	307	33,369	小売
LKQ CORP	70	76	249	26,987	小売
HORMEL FOODS CORP	33	72	290	31,500	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	34	37	280	30,412	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	26	26	76	8,338	小売
HARRIS CORP	24	31	237	25,763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	36	37	629	68,188	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	39	41	124	13,501	エネルギー
NRG ENERGY INC	78	79	125	13,564	公益事業
INVESCO LTD	101	106	308	33,382	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	36	40	332	36,006	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	34	35	169	18,370	各種金融
TERADATA CORP	36	33	91	9,949	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	40	41	220	23,935	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	28	32	376	40,814	エネルギー
MSCI INC	—	24	183	19,920	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	23	93	10,179	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	35	46	461	50,048	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	365	387	3,948	427,856	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	463	487	3,765	408,035	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	45	47	447	48,506	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	10	10	130	14,139	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	96	114	280	30,441	エネルギー
FLOWSERVE CORP	31	32	152	16,540	資本財
HELMERICH & PAYNE	25	26	160	17,387	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	42	—	—	—	公益事業
ENERGEN CORP	17	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	57	71	291	31,615	電気通信サービス
LORILLARD INC	87	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	18	125	13,612	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	62	69	193	20,997	メディア
RESMED INC	32	34	201	21,797	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	—	20	202	21,931	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	57	59	279	30,262	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	30	30	220	23,857	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CHURCH & DWIGHT CO INC	31	32	316	34,246	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	22	23	192	20,847	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	19	—	—	—	公益事業
PERRIGO CO PLC	33	36	339	36,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	50	39	94	10,238	資本財
FMC CORP	30	33	157	17,067	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	28	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	22	24	192	20,823	資本財
EVERSOURCE ENERGY	75	80	461	49,996	公益事業
NETSUITE INC	8	10	78	8,519	ソフトウェア・サービス
ALLERGAN PLC	88	98	2,197	238,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	15	13	192	20,865	素材
CROWN HOLDINGS INC	32	35	191	20,713	素材
CALPINE CORP	79	86	129	14,038	公益事業
EATON VANCE CORP	26	28	99	10,831	各種金融
DELTA AIR LINES INC	49	50	212	22,975	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	47	49	420	45,518	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	59	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	42	45	341	37,051	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	37	40	312	33,871	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	71	73	612	66,352	小売
FORTINET INC	—	36	119	12,928	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	22	23	109	11,827	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	249	27,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	41	42	141	15,311	銀行
QEP RESOURCES INC	41	—	—	—	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	240	292	158	17,138	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	302	353	1,099	119,161	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	34	291	31,536	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	100	95	782	84,809	素材
HCA HOLDINGS INC	71	81	655	71,069	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	104	95	83	9,100	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	48	—	—	—	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	32	—	—	—	素材
HOLLYFRONTIER CORP	43	43	127	13,810	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	65	133	479	51,930	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	26	193	20,999	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	—	39	223	24,178	資本財
XYLEM INC	43	44	192	20,859	資本財
TRIPADVISOR INC	27	29	194	21,065	小売
MEDIVATION INC	18	41	250	27,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	14	15	229	24,858	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	30	36	250	27,106	銀行
ALLEGHANY CORP	3	3	203	22,009	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	18	19	713	77,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	130	133	1,060	114,925	エネルギー
FACEBOOK INC-A	470	568	6,792	736,135	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	67	70	295	32,010	公益事業
ALBEMARLE CORP	26	28	209	22,748	素材
PVH CORP	19	20	171	18,634	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	25	28	372	40,357	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	
KINDER MORGAN INC	423	475	810	87,839	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	67	—	—	—	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	80	86	450	48,810	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	69	70	492	53,412	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	18	21	456	49,434	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	37	42	148	16,096	資本財
SPLUNK INC	—	32	155	16,822	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	40	—	—	—	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	138	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP	45	51	157	17,097	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	14	15	133	14,496	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	374	409	2,566	278,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A	22	—	—	—	メディア
TESLA MOTORS INC	20	24	514	55,706	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	53	56	184	19,998	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	34	36	116	12,640	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29	32	164	17,878	各種金融
ZOETIS INC	117	118	545	59,087	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	27	29	167	18,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	91	95	116	12,609	メディア
SPRINT CORP	192	199	69	7,547	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	—	59	165	17,983	公益事業
SNAP-ON INC	13	14	236	25,626	資本財
AGL RESOURCES INC	—	25	167	18,152	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	48	46	202	21,972	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	89	145	212	23,002	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	33	39	218	23,644	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	23	28	201	21,798	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	31	37	260	28,184	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	21	22	310	33,607	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	22	23	89	9,662	資本財
PHARMACYCLICS INC	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	18	19	298	32,335	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	46	111	12,065	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	68	77	5,568	603,461	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	41	104	11,276	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP	98	90	115	12,566	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	40	53	72	7,907	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	23	23	143	15,594	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	43	40	132	14,326	運輸
VOYA FINANCIAL INC	53	53	163	17,772	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	11	11	52	5,686	素材
ANTERO RESOURCES CORP	12	20	54	5,865	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	15	23	153	16,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C	48	—	—	—	メディア
ALLY FINANCIAL INC	99	108	184	20,004	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	92	123	275	29,859	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	—	34	175	18,982	ソフトウェア・サービス
JARDEN CORP	42	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	27	40	187	20,341	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	16	20	285	30,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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		
SIGNET JEWELERS LTD	17	18	196	21,285	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	38	208	624	67,711	各種金融	
QORVO INC	34	35	162	17,633	半導体・半導体製造装置	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	27	30	99	10,762	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	44	208	22,625	保険	
ACUITY BRANDS INC	—	10	276	29,922	資本財	
JONES LANG LASALLE INC	—	11	125	13,637	不動産	
ARAMARK	—	56	187	20,340	消費者サービス	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	131	292	31,662	銀行	
LEAR CORP	—	18	217	23,534	自動車・自動車部品	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	19	103	11,169	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WHITEWAVE FOODS CO	—	44	194	21,099	食品・飲料・タバコ	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	35	101	10,984	素材	
RITE AID CORP	—	219	175	19,011	食品・生活必需品小売り	
BAXALTA INC	—	170	725	78,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	97	249	27,001	エネルギー	
WESTROCK CO	—	64	275	29,837	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	151	1,293	140,214	食品・飲料・タバコ	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	275	1,092	118,433	ソフトウェア・サービス	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	13	64	7,041	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	—	25	68	7,471	ソフトウェア・サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	451	723	78,426	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOBILEYE NV	—	20	73	7,984	ソフトウェア・サービス	
AMERCO	—	1	72	7,802	運輸	
CDW CORP/DE	—	35	149	16,167	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDNAX INC	—	23	162	17,642	ヘルスケア機器・サービス	
SABRE CORP	—	51	151	16,405	ソフトウェア・サービス	
WR GRACE & CO	—	18	140	15,250	素材	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	37	132	14,401	耐久消費財・アパレル	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	50	159	17,288	メディア	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	—	22	72	7,896	メディア	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	120	73	7,984	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	60	319	34,656	資本財	
小 計	株 数	金 額	73,188	78,527	459,203	49,763,830
銘 柄 数 < 比 率 >	593	596	—	< 57.1% >		
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	339	371	2,842	239,716	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	70	75	303	25,615	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	85	86	453	38,241	メディア	
TRANSCANADA CORP	167	178	921	77,725	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	85	91	449	37,909	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	144	153	660	55,661	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	133	142	178	15,088	素材	
BARRICK GOLD CORP	275	291	689	58,184	素材	
BCE INC	34	36	214	18,090	電気通信サービス	
AGRIUM INC	34	33	367	30,987	素材	
BOMBARDIER INC-B	333	487	98	8,336	資本財	
BANK OF MONTREAL	152	160	1,304	109,966	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	134	221	962	81,182	不動産	
BANK OF NOVA SCOTIA	286	301	1,889	159,381	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	75	81	274	23,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	66	68	105	8,911	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CAMECO CORP	94	100	151	12,767	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	52	59	159	13,458	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	93	99	995	83,929	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	257	274	1,016	85,701	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	192	199	1,522	128,362	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	18	250	21,108	小売
ENBRIDGE INC	200	230	1,178	99,403	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5	6	386	32,619	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	52	55	320	27,063	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	80	88	134	11,300	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	25	25	92	7,830	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	53	57	393	33,166	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	463	493	902	76,081	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	98	101	529	44,639	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	77	86	358	30,264	銀行
ONEX CORPORATION	21	21	166	14,043	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	195	209	428	36,113	素材
POWER CORP OF CANADA	88	94	271	22,861	保険
POWER FINANCIAL CORP	60	63	197	16,618	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	94	102	245	20,686	メディア
SUNCOR ENERGY INC	342	396	1,365	115,111	エネルギー
TRANSALTA CORP	67	—	—	—	公益事業
WESTON (GEORGE) LTD	12	13	143	12,083	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	40	36	637	53,735	運輸
ENCANA CORP	192	211	189	15,960	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	49	54	323	27,295	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	42	43	94	7,959	資本財
GOLDCORP INC	192	208	500	42,237	素材
KINROSS GOLD CORP	272	308	207	17,506	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	36	38	195	16,509	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	70	75	256	21,643	保険
METHANEX CORP	21	23	89	7,589	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	179	252	89	7,565	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	18	21	40	3,389	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	55	58	221	18,654	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	61	64	266	22,500	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	120	125	107	9,076	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	47	41	166	14,044	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	139	173	159	13,465	素材
YAMANA GOLD INC	219	237	146	12,331	素材
FORTIS INC	66	71	288	24,332	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	98	105	566	47,788	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	167	179	111	9,404	素材
TORONTO-DOMINION BANK	433	464	2,600	219,318	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	36	44	394	33,298	素材
SILVER WHEATON CORP	97	101	250	21,088	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	13	41	88	7,433	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	24	26	107	9,092	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	32	116	9,857	公益事業
METRO INC	59	60	256	21,655	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	29	30	213	18,023	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	31	33	292	24,634	保険

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
CRESCENT POINT ENERGY CORP	101	126	256	21,633	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	194	209	397	33,487	エネルギー	
MEG ENERGY CORP	39	—	—	—	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	77	86	176	14,910	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	110	—	—	—	エネルギー	
BAYTEX ENERGY CORP	39	—	—	—	エネルギー	
TOURMALINE OIL CORP	39	47	144	12,179	エネルギー	
ENERPLUS CORP	46	—	—	—	エネルギー	
NEW GOLD INC	128	—	—	—	素材	
PEMBINA PIPELINE CORP	78	93	344	29,010	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	25	28	117	9,903	エネルギー	
CATAMARAN CORP	49	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
DOLLARAMA INC	29	30	273	23,085	小売	
KEYERA CORP	40	43	158	13,387	エネルギー	
ALTAGAS LTD	30	37	109	9,273	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	33	38	121	10,216	エネルギー	
ATCO LTD -CLASS I	19	20	84	7,136	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	28	59	5,008	不動産	
INTER PIPELINE LTD	77	85	219	18,543	エネルギー	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	32	46	112	9,523	エネルギー	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	41	98	8,332	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	5	255	21,507	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	4	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	14	—	—	—	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	45	50	268	22,653	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	17	17	73	6,226	素材	
VERESEN INC	—	75	68	5,780	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	7	157	13,292	素材	
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	97	145	12,286	各種金融	
LINAMAR CORP	—	12	62	5,269	自動車・自動車部品	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	23	98	8,328	商業・専門サービス	
小 計	株数・金額	9,172	9,959	35,713	3,011,704	
	銘柄数<比率>	93	90	—	<3.5%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	249	266	187	23,195	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	324	345	508	62,901	各種金融	
METRO AG	37	44	125	15,593	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	186	198	1,871	231,711	資本財	
RWE AG	115	123	141	17,481	公益事業	
BASF SE	215	229	1,571	194,628	素材	
VOLKSWAGEN AG	6	8	123	15,336	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	226	240	1,430	177,142	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	41	44	453	56,199	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	471	502	403	49,934	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	78	82	637	78,948	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	194	207	2,070	256,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINDE AG	43	46	587	72,796	素材	
ALLIANZ SE-REG	107	114	1,586	196,441	保険	
MAN SE	8	7	70	8,770	資本財	
CONTINENTAL AG	25	27	514	63,749	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	265	282	339	42,060	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	36	38	185	22,953	自動車・自動車部品	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	57	60	75	9,353	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	15	16	93	11,576	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	227	242	641	79,380	運輸	
SAP SE	216	245	1,676	207,547	ソフトウェア・サービス	
CELESIO AG	11	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	51	54	233	28,952	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	45	48	368	45,589	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	51	54	409	50,732	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	10	54	6,697	運輸	
ADIDAS AG	48	52	593	73,448	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	747	806	1,262	156,302	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	40	41	661	81,907	保険	
THYSSENKRUPP AG	106	92	175	21,676	素材	
BEIERSDORF AG	23	25	199	24,641	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	33	35	267	33,114	素材	
MERCK KGAA	30	32	259	32,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	38	46	604	74,834	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	21	22	101	12,536	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	89	95	618	76,615	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	69	84	229	28,422	不動産	
GEA GROUP AG	42	45	184	22,840	資本財	
SYMRISE AG	29	30	176	21,894	素材	
K+S AG-REG	40	47	107	13,347	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	27	25	234	29,002	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	28	30	133	16,573	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	12	13	93	11,568	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	14	15	145	18,012	保険	
BRENNTAG AG	36	38	184	22,849	資本財	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	5	—	—	—	メディア	
AXEL SPRINGER SE	8	11	55	6,834	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	15	17	64	7,967	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	137	186	84	10,517	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	21	22	102	12,645	資本財	
VONOVIA SE	80	116	354	43,875	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	34	100	12,417	素材	
ZALANDO SE	—	21	63	7,907	小売	
小 計	株数・金額	5,071	5,538	23,421	2,899,839	
	銘柄数<比率>	52	52	—	<3.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	273	291	381	47,257	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	962	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	2,980	3,174	716	88,677	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	2,384	2,874	243	30,140	電気通信サービス	
ENI SPA	598	636	855	105,911	エネルギー	
UNICREDIT SPA	1,033	1,194	338	41,954	銀行	
ENEL SPA	1,551	1,968	781	96,759	公益事業	
SAIPEM SPA	59	1,524	55	6,911	エネルギー	
ATLANTIA SPA	97	103	249	30,885	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	212	230	50	6,190	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	39	42	201	24,921	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	146	140	90	11,168	各種金融	
SNAM SPA	494	533	282	34,940	公益事業	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELECOM ITALIA-RSP	1,370	1,500	102	12,654	電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC	85	90	39	4,940	銀行
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	96	101	108	13,483	資本財
PIRELLI & C.	55	—	—	—	自動車・自動車部品
UBI BANCA SPA	201	226	71	8,872	銀行
TERNA SPA	364	387	187	23,271	公益事業
UNIPOLSAI SPA	216	273	52	6,460	保険
PRYSMIAN SPA	48	48	104	12,954	資本財
EXOR SPA	22	27	88	10,991	各種金融
ENEL GREEN POWER SPA	431	—	—	—	公益事業
小 計	株 数 銘柄 数 < 比 率 >	13,728 23	15,372 20	5,002 —	619,349 < 0.7% >
(ユーロ…フランス)					
MICHELIN (CGDE)	43	46	424	52,565	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	65	69	1,024	126,815	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	92	111	151	18,765	自動車・自動車部品
AXA SA	426	492	1,026	127,103	保険
DANONE	136	147	893	110,637	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	129	138	334	41,427	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	285	290	478	59,264	メディア
INGENICO GROUP	—	13	140	17,423	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALCATEL-LUCENT SA	663	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	170	181	598	74,111	銀行
AIR LIQUIDE SA	81	86	820	101,577	素材
TOTAL SA	503	549	2,356	291,751	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	105	119	459	56,861	資本財
ZODIAC AEROSPACE	42	50	106	13,147	資本財
VINCI SA	111	120	775	95,966	資本財
LAFARGE SA	43	—	—	—	素材
SANOFI	280	294	2,043	252,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	99	114	227	28,172	公益事業
L'OREAL	59	62	1,002	124,058	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	49	53	205	25,461	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	123	139	767	95,029	資本財
BNP PARIBAS	248	265	1,169	144,810	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	47	51	586	72,597	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	33	40	333	41,331	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	12	14	72	8,969	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	17	19	276	34,192	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	6	6	210	26,091	耐久消費財・アパレル
VALLOUREC SA	26	—	—	—	エネルギー
SODEXO	22	23	209	25,927	消費者サービス
KERING	17	18	273	33,885	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	30	32	221	27,453	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	23	26	123	15,329	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	12	13	206	25,612	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	19	21	176	21,854	ソフトウェア・サービス
ORANGE	436	496	730	90,441	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	41	43	60	7,502	保険
IMERYS SA	7	8	55	6,824	素材
SAFRAN SA	68	78	468	58,007	資本財
RENAULT SA	45	48	390	48,384	自動車・自動車部品

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PUBLICIS GROUPE	44	47	297	36,820	メディア
LAGARDERE SCA	28	29	62	7,768	メディア
JC DECAUX SA	14	18	66	8,193	メディア
SOCIETE BIC SA	6	7	89	11,049	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	39	50	147	18,271	資本財
THALES SA	21	26	202	25,042	資本財
PERNOD RICARD SA	49	53	508	62,920	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	242	264	240	29,781	銀行
ENGIE	341	367	483	59,827	公益事業
ALSTOM	52	38	85	10,581	資本財
ARKEMA	15	16	119	14,836	素材
LEGRAND SA	62	66	325	40,263	資本財
SCOR SE	34	38	112	13,949	保険
ADP	7	7	81	10,102	運輸
EDF	58	62	70	8,713	公益事業
NATIXIS	223	236	99	12,275	銀行
WENDEL	7	7	76	9,429	各種金融
BUREAU VERITAS SA	63	66	134	16,668	商業・専門サービス
EURAZEO	9	10	62	7,708	各種金融
EURAZEO-NEW	0.45	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	73	76	116	14,425	公益事業
ILIAD SA	6	6	128	15,873	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	35	42	116	14,389	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	112	118	133	16,544	運輸
EDENRED	50	52	89	11,044	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	5	6	44	5,462	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	65	75	99	12,315	資本財
BOLLORE	200	219	73	9,147	運輸
NUMERICABLE-SFR	22	27	76	9,432	電気通信サービス
小 計	株 数	金 額			
銘 柄 数 < 比 率 >	67	64	—	< 3.3% >	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N. V.	55	55	106	13,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	218	237	148	18,356	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	211	224	151	18,701	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	32	122	15,114	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	138	147	821	101,658	資本財
STMICROELECTRONICS NV	148	159	75	9,345	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	18	20	114	14,230	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	70	75	258	32,044	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	753	802	278	34,497	電気通信サービス
AKZO NOBEL	57	61	379	47,032	素材
HEINEKEN NV	54	57	477	59,070	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	219	238	550	68,153	資本財
RELX NV	165	249	370	45,849	メディア
AEGON NV	426	456	220	27,283	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	210	208	402	49,807	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	29	32	149	18,499	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	23	25	182	22,598	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	40	45	238	29,548	素材
ING GROEP NV-CVA	907	968	1,012	125,327	銀行
ASML HOLDING NV	82	86	704	87,177	半導体・半導体製造装置

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		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
UNILEVER NV-CVA	382	407	1,599	197,980	家庭用品・パーソナル用品		
VOPAK	17	17	83	10,303	エネルギー		
BOSKALIS WESTMINSTER	19	21	77	9,546	資本財		
DELTA LLOYD NV	49	—	—	—	保険		
TNT EXPRESS NV	102	105	84	10,434	運輸		
OCI NV	19	21	30	3,810	素材		
NN GROUP NV	36	79	234	29,067	保険		
ALTICE NV - B	—	26	37	4,617	メディア		
ALTICE NV - A	—	93	128	15,877	メディア		
小 計	株 数	金 額	4,459	4,960	9,038	1,119,109	
	銘柄 数 < 比 率 >		26	28	—	< 1.3% >	
(ユーロ…スペイン)							
BANCO POPULAR ESPANOL	417	431	89	11,083	銀行		
ENDESA SA	77	80	146	18,188	公益事業		
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	39	47	131	16,294	資本財		
IBERDROLA SA	1,211	1,380	833	103,189	公益事業		
TELEFONICA SA	1,050	1,126	1,043	129,152	電気通信サービス		
BANCO SANTANDER SA	3,381	3,609	1,457	180,501	銀行		
BANKINTER SA	162	167	106	13,151	銀行		
REPSOL SA	243	274	308	38,240	エネルギー		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,478	1,590	876	108,527	銀行		
GAS NATURAL SDG SA	81	89	150	18,575	公益事業		
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	256	272	761	94,304	小売		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	98	130	188	23,336	運輸		
MAPPRE SA	201	261	55	6,880	保険		
FERROVIAL SA	99	118	214	26,556	資本財		
FERROVIAL SA-RTS	99	—	—	—	資本財		
ZARDOYA OTIS SA	41	44	40	5,007	資本財		
ENAGAS SA	47	55	145	18,000	公益事業		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	26	27	213	26,493	公益事業		
BANCO DE SABADELL SA	1,012	1,279	196	24,366	銀行		
CAIXABANK S.A	539	663	158	19,645	銀行		
GRIFOLS SA	35	74	137	16,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	105	109	437	54,134	ソフトウェア・サービス		
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	192	207	136	16,839	運輸		
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	141	146	70	8,691	食品・生活必需品小売り		
BANKIA SA	1,050	1,143	87	10,831	銀行		
AENA SA	14	16	206	25,521	運輸		
小 計	株 数	金 額	12,109	13,348	8,193	1,014,490	
	銘柄 数 < 比 率 >		26	25	—	< 1.2% >	
(ユーロ…ベルギー)							
AGEAS	51	50	163	20,264	保険		
UCB SA	29	31	211	26,124	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	189	201	2,238	277,198	食品・飲料・タバコ		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	18	20	148	18,354	各種金融		
DELHAIZE GROUP	23	21	200	24,805	食品・生活必需品小売り		
UMICORE	21	23	106	13,241	素材		
COLRUYT SA	16	17	89	11,055	食品・生活必需品小売り		
KBC GROEP NV	59	62	286	35,520	銀行		
SOLVAY SA	13	18	165	20,540	素材		
PROXIMUS	34	38	106	13,243	電気通信サービス		

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELENET GROUP HOLDING NV	11	13	57	7,078	メディア
小 計	株数・金額	471	499	3,775	467,426
	銘柄数<比率>	11	11	-	<0.5%>
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	67	70	164	20,413	銀行
OMV AG	33	37	94	11,660	エネルギー
VOESTALPINE AG	25	28	82	10,191	素材
IMMOFINANZ AG	247	-	-	-	不動産
ANDRITZ AG	16	19	88	10,969	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	30	29	36	4,485	銀行
VIENNA INSURANCE GROUP AG	9	-	-	-	保険
小 計	株数・金額	430	185	466	57,721
	銘柄数<比率>	7	5	-	<0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルク)					
RTL GROUP	8	9	71	8,912	メディア
TENARIS SA	109	117	132	16,404	エネルギー
SES	71	81	197	24,482	メディア
ARCELORMITTAL	233	426	185	22,948	素材
ALTICE SA	20	-	-	-	メディア
小 計	株数・金額	443	635	587	72,748
	銘柄数<比率>	5	4	-	<0.1%>
(ユーロ…フィンランド)					
NOKIA OYJ	880	1,444	670	82,973	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	137	101	12,602	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	25	28	92	11,431	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	125	133	221	27,460	素材
FORTUM OYJ	103	112	143	17,753	公益事業
KONE OYJ-B	73	84	332	41,107	資本財
METSO OYJ	27	28	57	7,090	資本財
SAMPO OYJ-A SHS	105	111	437	54,121	保険
WARTSILA OYJ ABP	35	36	135	16,725	資本財
ELISA OYJ	34	35	115	14,266	電気通信サービス
NESTE OYJ	28	32	92	11,480	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	24	25	77	9,648	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	1,595	2,210	2,476	306,661
	銘柄数<比率>	12	12	-	<0.4%>
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	38	40	328	40,651	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC	-	20	226	28,030	消費者サービス
BANK OF IRELAND	6,546	7,084	174	21,578	銀行
CRH PLC	195	209	535	66,284	素材
小 計	株数・金額	6,780	7,355	1,264	156,545
	銘柄数<比率>	3	4	-	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	558	586	182	22,600	公益事業
JERONIMO MARTINS	58	62	86	10,723	食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	8,533	10,346	33	4,099	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA	90	116	136	16,941	エネルギー
小 計	株数・金額	9,240	11,112	439	54,364
	銘柄数<比率>	4	4	-	<0.1%>
ユ ー ロ 計	株数・金額	60,858	67,551	78,212	9,683,428
	銘柄数<比率>	236	229	-	<11.1%>

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	
BARCLAYS PLC	3,869	4,201	687	107,587	銀行
BP PLC	4,291	4,586	1,656	259,310	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	13,429	14,294	938	146,970	銀行
ASTRAZENECA PLC	296	316	1,243	194,675	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	91	98	108	16,995	資本財
NEXT PLC	36	36	193	30,345	小売
DIAGEO PLC	591	629	1,187	185,800	食品・飲料・タバコ
SKY PLC	243	259	240	37,714	メディア
BAE SYSTEMS PLC	743	791	388	60,781	資本財
UNILEVER PLC	301	320	1,011	158,265	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	1,909	2,039	324	50,861	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	266	278	342	53,592	メディア
MARKS & SPENCER GROUP PLC	384	408	170	26,699	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	151	159	1,093	171,162	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	603	643	841	131,729	保険
BG GROUP PLC	802	—	—	—	エネルギー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,397	1,488	322	50,552	保険
SAGE GROUP PLC/THE	253	270	161	25,333	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	4,511	4,899	2,112	330,650	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	438	466	1,980	310,041	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	166	175	166	26,047	公益事業
SCHRODERS PLC	28	31	76	12,024	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	598	869	185	29,084	銀行
BHP BILLITON PLC	496	528	442	69,215	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	225	240	912	142,846	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	309	323	518	81,185	メディア
CENTRICA PLC	1,169	1,276	268	41,970	公益事業
BT GROUP PLC	1,916	2,118	925	144,898	電気通信サービス
SSE PLC	232	254	384	60,202	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	580	819	407	63,770	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	442	460	303	47,440	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	64,630	32,679	3	511	資本財
COMPASS GROUP PLC	392	411	514	80,543	消費者サービス
KINGFISHER PLC	553	572	207	32,542	小売
PEARSON PLC	193	205	166	25,994	メディア
SEVERN TRENT PLC	56	61	136	21,406	公益事業
RIO TINTO PLC	299	310	630	98,669	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,143	1,218	1,797	281,309	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	227	244	1,034	161,878	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	36	102	16,080	各種金融
3I GROUP PLC	226	241	115	18,054	各種金融
GKN PLC	378	428	120	18,826	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	6,232	6,644	1,477	231,189	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	555	105	16,467	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	298	336	88	13,847	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	940	1,011	428	67,069	保険
CAPITA PLC	155	166	182	28,570	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	222	244	101	15,850	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	48	48	139	21,837	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	232	254	122	19,134	保険
WHITBREAD PLC	42	45	179	28,018	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	888	941	938	146,967	公益事業

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	
ARM HOLDINGS PLC	330	351	332	52,088	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	61	63	249	39,099	資本財
BUNZL PLC	77	84	175	27,393	資本財
COBHAM PLC	263	286	46	7,241	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	328	350	216	33,899	素材
INTERTEK GROUP PLC	39	40	135	21,167	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	203	220	67	10,557	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	104	111	130	20,383	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	56	49	133	20,895	消費者サービス
CARNIVAL PLC	43	47	170	26,692	消費者サービス
PERSIMMON PLC	71	76	149	23,451	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	193	193	79	12,490	資本財
ICAP PLC	124	138	64	10,046	各種金融
ITV PLC	900	957	206	32,271	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	73	78	202	31,663	各種金融
G4S PLC	360	390	75	11,797	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	32	92	14,550	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	86	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	250	131	20,527	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	61	68	67	10,562	資本財
REXAM PLC	163	147	92	14,490	素材
SMITH & NEPHEW PLC	209	224	259	40,612	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	107	116	71	11,122	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	813	146	22,856	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	920	986	1,711	267,897	エネルギー
PETROFAC LTD	60	64	53	8,356	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	57	62	113	17,710	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	572	992	1,733	271,333	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	1,155	1,233	212	33,216	保険
INVESTEC PLC	127	139	67	10,495	各種金融
STANDARD LIFE PLC	459	493	157	24,659	保険
EXPERIAN PLC	232	242	306	47,931	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	91	123	19,395	素材
WEIR GROUP PLC/THE	49	53	60	9,403	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	84	89	276	43,327	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	89	98	41	6,566	素材
TULLOW OIL PLC	208	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	138	148	621	97,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	99	112	90	14,108	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	47	52	101	15,886	保険
FRESNILLO PLC	49	55	59	9,318	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	20	23	141	22,189	素材
AGGREKO PLC	58	64	67	10,601	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	56	63	60	9,526	商業・専門サービス
ST JAMES' S PLACE PLC	—	131	114	17,867	保険
GLENCORE PLC	2,617	3,062	419	65,601	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	220	230	61	9,634	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC	54	65	82	12,885	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	31	32	98	15,464	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	223	—	—	—	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	49	50	70	10,987	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC	37	41	62	9,726	運輸

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
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	350	343	130	20,351	保険	
ROYAL MAIL PLC	150	225	112	17,590	運輸	
ASHTED GROUP PLC	120	126	113	17,716	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	60	67	25	3,968	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	164	177	76	12,014	消費者サービス	
TUI AG-DI	107	124	130	20,486	消費者サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	92	80	12,621	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	239	91	14,292	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	—	349	91	14,377	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	130,994	105,469	39,248	6,143,134	
	銘柄 数 < 比 率 >	104	109	—	< 7.0% >	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	758	798	5,805	648,086	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	122	130	812	90,663	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	359	449	614	68,623	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	53	113	502	56,067	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	165	175	4,291	479,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	2	2	445	49,742	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	12	13	182	20,387	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35	37	813	90,811	保険	
SYNGENTA AG-REG	21	23	901	100,619	素材	
LONZA GROUP AG-REG	12	13	223	24,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	12	79	8,853	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	10	192	21,506	資本財	
GEBERIT AG-REG	8	9	348	38,903	資本財	
SWISS RE AG	82	87	765	85,454	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	7	248	27,703	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	6	7	50	5,622	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	540	569	4,171	465,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	40	41	244	27,279	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	5	6	311	34,800	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	517	550	1,114	124,363	資本財	
SGS SA-REG	1	1	286	31,993	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	6	3	29	3,286	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4	5	92	10,286	資本財	
ACTELION LTD-REG	24	25	402	44,950	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	12	13	184	20,539	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	11	12	145	16,242	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7	8	193	21,638	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.03	216	24,147	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	21	21	83	9,283	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	52	56	220	24,589	各種金融	
SIKA AG-BR	0.49	0.54	226	25,251	素材	
TRANSOCEAN LTD	85	—	—	—	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	14	16	141	15,770	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.23	0.25	151	16,939	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3	4	160	17,939	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.53	0.56	65	7,270	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	98	11,003	素材	
UBS GROUP AG-REG	859	915	1,418	158,345	各種金融	
DUFREY AG-REG	—	10	132	14,766	小売	

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	
(スイス) GALENICA AG-REG	百株 —	百株 0.98	千スイスフラン 131	千円 14,692	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>	3,883 38	4,161 39	26,499 —	2,958,154 <3.4%>	
(スウェーデン) ELECTROLUX AB-SER B	57	60	千スウェーデンクローネ 1,387	18,496	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	716	761	4,720	62,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	91	97	1,829	24,382	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	357	380	2,857	38,087	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	106	113	3,085	41,131	各種金融	
NORDEA BANK AB	714	759	5,810	77,454	銀行	
GETINGE AB-B SHS	48	50	848	11,308	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	117	375	3,866	51,542	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	157	168	3,426	45,676	資本財	
SKF AB-B SHARES	92	99	1,449	19,317	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	78	250	4,135	55,128	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	223	237	6,301	84,000	小売	
SANDVIK AB	248	267	2,128	28,369	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	213	226	3,913	52,167	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	72	78	982	13,101	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	137	151	3,828	51,032	家庭用品・パーソナル用品	
SKANSKA AB-B SHS	91	94	1,711	22,814	資本財	
SWEDISH MATCH AB	46	49	1,341	17,885	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	77	79	615	8,209	電気通信サービス	
TELIA CO AB	608	647	2,431	32,416	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	359	385	3,578	47,703	資本財	
ALFA LAVAL AB	75	73	921	12,281	資本財	
ELEKTA AB-B SHS	88	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	54	54	809	10,790	エネルギー	
BOLIDEN AB	62	68	926	12,349	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	94	104	683	9,117	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	16	748	9,974	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	59	64	2,021	26,949	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	54	58	1,297	17,289	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	36	40	556	7,421	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	17	20	553	7,381	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,179 31	5,836 30	68,770 —	916,705 <1.1%>	
(ノルウェー) DNB ASA	230	245	千ノルウェークローネ 2,416	32,090	銀行	
NORSK HYDRO ASA	309	335	1,069	14,203	素材	
ORKLA ASA	185	203	1,534	20,381	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	262	279	3,777	50,164	エネルギー	
TELENOR ASA	176	187	2,597	34,500	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	41	44	1,309	17,392	素材	
SUBSEA 7 SA	67	—	—	—	エネルギー	
SEADRILL LTD	93	—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48	50	688	9,148	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	18	509	6,761	メディア	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	22	576	7,661	メディア	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,416 9	1,388 9	14,480 —	192,305 <0.2%>	

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		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	471	490	17,581	292,558	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	56	58	1,845	30,703	素材	
DANSKE BANK A/S	154	177	3,245	54,002	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	4	6	411	6,851	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	56	2,548	42,405	資本財	
TDC A/S	190	203	693	11,546	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	24	26	1,663	27,688	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	25	27	1,373	22,850	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	43	48	1,372	22,839	運輸	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	1	1	1,508	25,102	運輸	
TRYG A/S	5	29	365	6,077	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.86	0.96	810	13,482	運輸	
PANDORA A/S	27	27	2,616	43,536	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	30	37	953	15,869	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	24	1,018	16,951	素材	
GENMAB A/S	—	13	1,300	21,632	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	1,089	1,230	39,308	654,098	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	16	—	< 0.8% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	757	805	1,494	119,419	素材	
CSL LTD	111	116	1,284	102,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD	598	659	87	6,988	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	175	186	493	39,423	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	650	730	1,784	142,586	銀行	
RIO TINTO LTD	103	106	492	39,321	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	321	347	407	32,529	保険	
LENDELEASE GROUP	129	141	190	15,261	不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	382	428	3,343	267,148	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	731	834	2,612	208,772	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	558	660	1,906	152,347	銀行	
BRAMBLES LTD	372	400	524	41,889	商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	127	147	50	4,009	運輸	
BORAL LTD	192	193	133	10,633	素材	
WOOLWORTHS LTD	297	319	729	58,298	食品・生活必需品小売り	
TELSTRA CORP LTD	1,015	1,082	618	49,390	電気通信サービス	
AMP LTD	703	754	439	35,092	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	198	217	93	7,457	消費者サービス	
AMCOR LIMITED	286	293	471	37,711	素材	
COMPUTERSHARE LTD	113	121	126	10,112	ソフトウェア・サービス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	140	147	11,748	消費者サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	68	77	547	43,765	各種金融	
CIMIC GROUP LTD	27	26	99	7,931	資本財	
ASX LTD	45	50	226	18,061	各種金融	
COCA-COLA AMATIL LTD	141	149	136	10,930	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD	13	14	170	13,657	ヘルスケア機器・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	106	114	225	17,982	素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	146	68	5,481	小売	
NEWCREST MINING LTD	181	192	395	31,638	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	553	621	375	30,024	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	261	442	224	17,947	エネルギー	
ORICA LTD	89	94	128	10,306	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	92	100	205	16,441	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		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
SANTOS LTD	236	422	171	13,701	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	304	327	421	33,652	保険	
TRANSURBAN GROUP	432	518	644	51,491	運輸	
WESFARMERS LTD	264	283	1,222	97,707	食品・生活必需品小売り	
TOLL HOLDINGS LTD	166	—	—	—	運輸	
CHALLENGER LTD	—	147	137	10,953	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	269	286	209	16,736	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	63	69	232	18,575	エネルギー	
OIL SEARCH LTD	—	345	233	18,619	エネルギー	
WORLEYPARSONS LTD	52	—	—	—	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	159	176	333	26,629	公益事業	
TATTS GROUP LTD	348	380	150	12,000	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	376	393	114	9,157	素材	
ASCIANO LTD	234	129	115	9,244	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	91	107	65	5,247	素材	
AUSNET SERVICES	463	514	83	6,665	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	88	93	112	8,972	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	405	431	139	11,140	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	106	118	114	9,126	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	519	535	243	19,456	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	159	187	191	15,337	食品・飲料・タバコ	
ALS LTD	105	—	—	—	商業・専門サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	32	36	253	20,265	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	13	14	56	4,509	消費者サービス	
SEEK LTD	79	84	138	11,057	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	89	97	111	8,901	銀行	
REA GROUP LTD	13	14	75	6,057	メディア	
TPG TELECOM LTD	68	76	88	7,079	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	286	449	125	10,053	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	684	701	221	17,721	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	50	66	40	3,272	各種金融	
SOUTH32 LTD	—	1,342	217	17,380	素材	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	116	103	8,240	電気通信サービス	
小 計	株 数	金 額	15,717	19,187	26,604	2,125,939
銘柄 数 < 比 率 >	61	63	—	< 2.4% >		
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	416	380	140	10,399	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223	202	135	10,043	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	88	155	81	6,066	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	165	144	124	9,223	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	87	79	73	5,437	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	290	283	77	5,747	公益事業	
MIGHTY RIVER POWER	156	156	47	3,551	公益事業	
小 計	株 数	金 額	1,429	1,402	681	50,468
銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >		
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	360	330	1,361	19,016	不動産	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	500	—	—	—	資本財	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	150	145	1,196	16,721	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	325	683	6,358	88,825	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	400	440	4,015	56,089	不動産	
MTR CORP	340	365	1,401	19,580	運輸	

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		
HONG KONG & CHINA GAS	1,500	1,767	2,555	35,695	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,210	1,370	987	13,799	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	340	2,616	36,549	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	260	280	5,202	72,677	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	290	320	389	5,436	運輸	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	530	550	781	10,910	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	450	485	3,540	49,460	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	244	276	1,277	17,846	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	282	294	815	11,392	銀行	
HANG SENG BANK LTD	180	194	2,659	37,156	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	160	515	7,197	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	240	320	287	4,009	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	60	50	274	3,831	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	710	750	855	11,944	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	180	200	566	7,907	耐久消費財・アパレル	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	180	1,352	18,897	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	870	940	2,105	29,415	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	325	335	1,026	14,344	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	960	1,050	536	7,495	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	1,380	1,480	648	9,055	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	145	175	340	4,757	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	370	360	433	6,055	資本財	
SANDS CHINA LTD	568	588	1,619	22,630	消費者サービス	
WHEELOCK & CO LTD	210	230	799	11,165	不動産	
WYNN MACAU LTD	360	396	442	6,184	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	430	510	242	3,391	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	520	620	298	4,174	各種金融	
AIA GROUP LTD	2,830	3,002	13,043	182,220	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	284	288	573	8,014	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	550	570	1,413	19,747	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	224	240	249	3,486	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	600	680	768	10,734	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	850	1,480	895	12,508	食品・飲料・タバコ	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	678	3,191	44,585	不動産	
小計	株数・金額	20,308	23,122	67,638	944,913	
	銘柄数<比率>	39	39	—	<1.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	713	780	649	51,530	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	377	414	160	12,706	メディア	
SEBPCORP INDUSTRIES LTD	248	249	66	5,272	資本財	
CAPITALAND LTD	608	648	193	15,315	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	97	110	88	7,014	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	26	26	88	7,017	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	410	440	645	51,193	銀行	
KEPPEL CORP LTD	352	363	185	14,740	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	301	329	577	45,819	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	380	398	125	9,974	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,877	1,998	767	60,849	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	138	143	166	13,212	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	193	208	155	12,306	各種金融	
SEBPCORP MARINE LTD	214	214	32	2,579	資本財	
UOL GROUP LTD	107	127	71	5,650	不動産	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
COMFORTDELGRO CORP LTD	510	547	152	12,060	運輸	
NOBLE GROUP LTD	1,050	1,188	41	3,300	資本財	
STARHUB LTD	140	162	53	4,252	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,661	1,801	65	5,215	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	428	492	161	12,837	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	1,488	1,539	116	9,276	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	766	796	140	11,142	不動産	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	470	487	43	3,476	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,555	13,460	4,750	376,744	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<0.4%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	110	127	210	6,057	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	202	228	4,581	132,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOALIM BM	250	263	511	14,753	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	13	14	352	10,153	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	315	348	485	14,001	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	0.75	—	—	—	素材	
DELEK GROUP LTD	1	1	85	2,472	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	469	481	390	11,253	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	31	34	147	4,264	銀行	
AZRIELI GROUP	—	9	137	3,967	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,395	1,508	6,901	199,042	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	337,188	332,807	—	77,020,470	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,257	1,259	—	<88.4%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	10	11	396	42,981	0.0	
MACERICH CO/THE	3	3	260	28,278	0.0	
PROLOGIS INC	11	13	614	66,641	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	185	20,076	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	3	340	36,850	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	380	41,258	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	2	268	29,112	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	269	29,183	0.0	
WELLTOWER INC	8	8	628	68,144	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3	3	502	54,501	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	1	191	20,730	0.0	
REALTY INCOME CORP	5	6	394	42,723	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	2	2	183	19,856	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	2	2	261	28,304	0.0	
UDR INC	5	6	239	25,994	0.0	
VENTAS INC	7	8	546	59,192	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	22	23	259	28,079	0.0	
RAYONIER INC	3	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	12	19	611	66,264	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	9	10	1,120	121,477	0.1	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	8	8	163	17,667	0.0	
VEREIT INC	20	22	218	23,661	0.0	
DUKE REALTY CORP	7	8	199	21,635	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	4	117	12,703	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	3	5	188	20,452	0.0	
EQUINIX INC	1	1	568	61,618	0.1	
COMMUNICATIONS SALES & LE	3	—	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	—	8	752	81,509	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	8	9	635	68,901	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	12	14	397	43,125	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	17	18	301	32,705	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	3	134	14,611	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	4	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	3	3	953	103,345	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	7	1,573	170,562	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	3	4	407	44,211	0.1	
KIMCO REALTY CORP	9	10	301	32,712	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	3	639	69,296	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	234	269	15,210	1,648,370	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<1.9% >	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	1	55	4,707	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	3	74	6,259	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3	3	110	9,304	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	6	8	240	20,270
		銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	<0.0%>
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		0.643	0.862	108	13,431	0.0
KLEPIERRE		4	5	224	27,832	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	2	578	71,613	0.1
FONCIERE DES REGIONS		0.705	0.753	61	7,571	0.0
ICADE		0.852	0.829	55	6,913	0.0
ユ ー ロ 計		口 数 ・ 金 額	8	10	1,028	127,361
		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		22	20	147	23,037	0.0
HAMMERSON PLC		18	19	113	17,793	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		18	19	227	35,567	0.0
INTU PROPERTIES PLC		22	23	69	10,831	0.0
SEGRO PLC		17	18	79	12,398	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	99	102	636	99,629
		銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		33	86	295	23,609	0.0
SCENTRE GROUP		126	135	621	49,694	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		48	—	—	—	—
GPT GROUP		39	46	242	19,342	0.0
MIRVAC GROUP		87	95	187	14,965	0.0
STOCKLAND		54	61	281	22,479	0.0
WESTFIELD CORP		46	50	538	42,997	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP		21	25	213	17,033	0.0
GOODMAN GROUP		40	45	327	26,131	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	499	545	2,706	216,254
		銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		54	57	2,668	37,271	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	54	57	2,668	37,271
		銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		62	62	102	8,152	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		51	53	74	5,874	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		61	63	132	10,490	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		51	54	131	10,464	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	226	233	441	34,982
		銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>
合 計		口 数 ・ 金 額	1,129	1,227	—	2,184,141
		銘柄 数 < 比 率 >	60	61	—	<2.5%>

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP EMINI	5,731	—
		SP/TSE60	351	—
		SWISS IX	326	—
		EURO ST	1,317	—
		SPI 200	417	—
		FTSE100	709	—

(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

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	千円 77,020,470	% 87.1
投資証券	2,184,141	2.5
コール・ローン等、その他	9,272,983	10.4
投資信託財産総額	88,477,594	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (82,826,860千円) の投資信託財産総額 (88,477,594千円) に対する比率は93.6%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=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 ユーロ=123.81円	1 イギリスポンド=156.52円
1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=79.91円	1 ニュージーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円
1 イスラエルシェゲル=28.84円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	171,037,436,269
コール・ローン等	7,392,203,399
株式(評価額)	77,020,470,111
投資証券(評価額)	2,184,141,395
未収入金	82,668,447,892
未収配当金	149,789,802
差入委託証拠金	1,622,383,670
(B) 負債	83,895,702,366
未払金	83,799,612,608
未払解約金	96,075,624
未払利息	11,274
その他未払費用	2,860
(C) 純資産総額(A-B)	87,141,733,903
元本	65,607,671,368
次期繰越損益金	21,534,062,535
(D) 受益権総口数	65,607,671,368口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,282円

<注記事項>

- ①期首元本額 65,433,713,446円
 期中追加設定元本額 17,061,058,936円
 期中一部解約元本額 16,887,101,014円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3282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)

ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	1,051,081,178円
三菱UFJ バランスファンド VA50型(適格機関投資家限定)	27,067,467,498円
三菱UFJ バランスファンド VA75型(適格機関投資家限定)	17,672,982,278円
三菱UFJ バランスファンド 55VA(適格機関投資家限定)	2,844,580,299円
三菱UFJ バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	2,436,864,226円
三菱UFJ バランスファンド 20VA(適格機関投資家限定)	4,290,435,491円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	28,650,357円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	163,847,640円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	10,051,762,401円
合計	65,607,671,368円

[お知らせ]

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	1,708,257,997
受取配当金	1,673,823,744
受取利息	1,544,378
その他収益金	33,956,315
支払利息	△ 1,066,440
(B) 有価証券売買損益	△ 5,589,684,531
売買益	20,008,114,196
売買損	△25,597,798,727
(C) 先物取引等取引損益	306,294,141
取引益	989,847,414
取引損	△ 683,553,273
(D) 保管費用等	△ 53,641,733
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 3,628,774,126
(F) 前期繰越損益金	25,694,912,156
(G) 追加信託差損益金	5,274,105,570
(H) 解約差損益金	△ 5,806,181,065
(I) 計(E+F+G+H)	21,534,062,535
次期繰越損益金(I)	21,534,062,535

(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。