

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3期（決算日：2017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3期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 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。

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	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 額
		税 込 分 配 金	期 騰 落	中 率	(円ヘッジ・円ベース) 期 騰 落 率				
(設定日)	円	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
3期(2017年5月12日)	12,233	0	17.9		352.04	16.0	92.9	6.0	2,970

(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 (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) 2016年 5 月12日	円 10,374	% —	% —	% 86.8	% 11.5	% 2.5
5 月末	10,616	2.3	310.03 2.1	88.6	11.5	2.5
6 月末	10,404	0.3	303.46 △ 0.0	82.4	7.8	2.5
7 月末	10,916	5.2	318.26 4.8	84.7	13.2	2.5
8 月末	10,987	5.9	319.70 5.3	84.7	12.9	2.4
9 月末	10,914	5.2	317.40 4.5	86.7	8.3	2.5
10月末	10,832	4.4	314.89 3.7	89.0	10.6	2.4
11月末	11,085	6.9	321.59 5.9	93.5	9.8	2.4
12月末	11,411	10.0	330.41 8.8	85.0	13.4	2.2
2017年 1 月末	11,527	11.1	333.95 10.0	86.1	8.8	2.2
2 月末	11,896	14.7	344.05 13.3	85.6	10.9	2.3
3 月末	12,014	15.8	346.89 14.3	86.7	10.1	2.3
4 月末	12,140	17.0	349.95 15.3	88.0	9.2	2.3
(期 末) 2017年 5 月12日	12,233	17.9	352.04 16.0	92.9	6.0	2.4

(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。

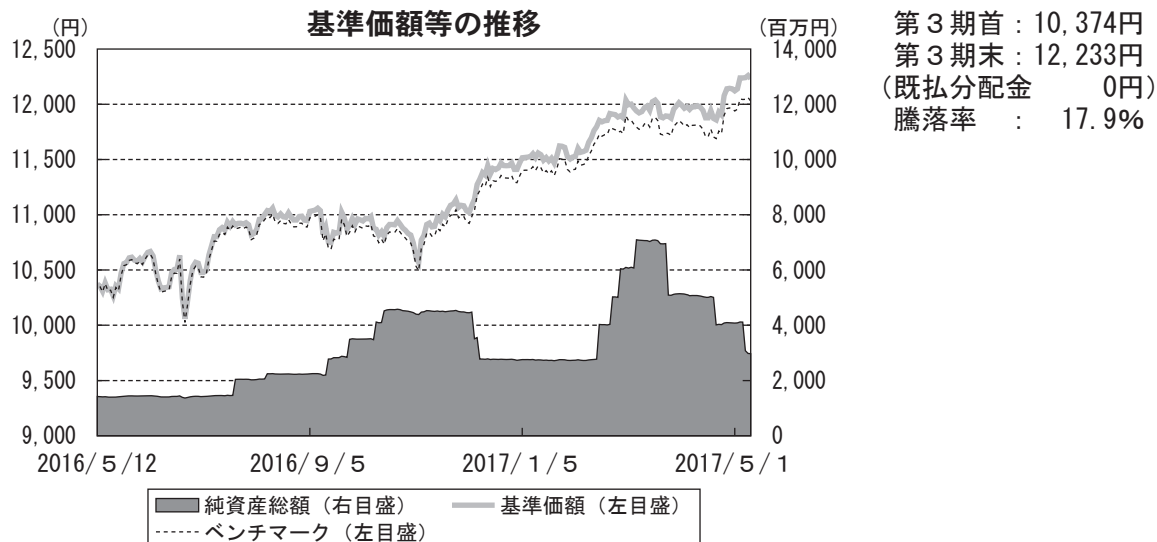
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第3期：2016/5/13～2017/5/12)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ17.9%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（16.0%）を1.9%上回りました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	米国の堅調な企業決算発表や米国大統領選挙結果を受けた今後の政策期待などから外国株式市況が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
------	--

投資環境について

(第3期：2016/5/13～2017/5/12)

◎外国株式市況

- ・米国の堅調な企業決算発表や米国大統領選挙結果を受けた今後の政策期待などから、外国株式市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜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18.6%の上昇となりました。

- ・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

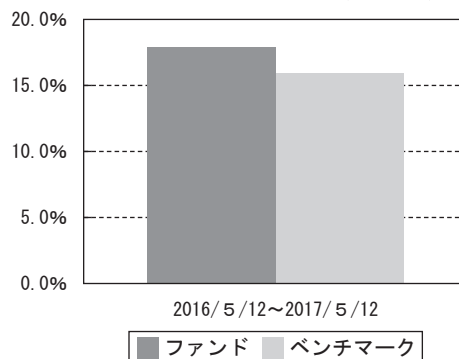
＜ヘッジ付先進国株式インデックスオープン＞
ベンチマークとのカイ離は1.9%程度となりました。

	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	△0.7%程度	2.6%程度	1.9%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△0.7%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2.6%程度でした。

基準価額（ベビーファンド）と
ベンチマークの対比（騰落率）

＜ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは16.0%の上昇となったため、カイ離は2.6%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	△0.1%程度	△0.1%程度	2.8%程度	2.6%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.1%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.1\%$ 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 2.8% 程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計	3.0%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した。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第3期
	2016年5月13日～2017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	2,233

（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

(2016年5月13日～2017年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	60	0.532	(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)	(48)	(0.426)	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)	(0.053)	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)	(0.053)	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	0.008	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.004)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(1)	(0.004)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.004	(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)	(0.003)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	4	0.037	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(4)	(0.033)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	65	0.581	
期中の平均基準価額は、11,228円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2016年5月13日～2017年5月12日)

先物取引の種類別取引状況

種 別	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 217	百万円 214	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 5, 125, 182	千円 7, 534, 000	千口 4, 318, 835	千円 6, 489, 600

○株式売買比率

(2016年5月13日～2017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	22, 878, 006千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	77, 889, 794千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 29

(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

(2016年5月13日～2017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 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 1,016,900	百万円 666,486	% 65.5	百万円 1,015,289	百万円 664,989	% 65.5
為替直物取引	3,799	1,433	37.7	18,844	17,690	93.9

平均保有割合 3.7%

※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 150	百万円 —	百万円 —	百万円 150	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2017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
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP EMINI	27	—
		EURO ST	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。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	千口 1,051,081	千口 1,857,428	千円 2,926,007

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

(2017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	千円 2,926,007	% 94.7
コール・ローン等、その他	162,991	5.3
投資信託財産総額	3,088,998	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（87,416,700千円）の投資信託財産総額（88,488,862千円）に対する比率は98.8%です。

(注) 期末における外貨建純資産（8,044千円）の投資信託財産総額（3,088,998千円）に対する比率は0.3%です。

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

1 アメリカドル=113.94円	1 カナダドル=83.13円	1 ユーロ=123.80円	1 イギリスポンド=146.77円
1 スイスフラン=113.06円	1 スウェーデンクローネ=12.83円	1 ノルウェークローネ=13.25円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=84.09円	1 ニュージーランドドル=77.83円	1 香港ドル=14.63円	1 シンガポールドル=80.91円
1 イスラエルシェケル=31.58円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,088,998,790
コール・ローン等	42,013,447
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	2,926,007,360
未収入金	102,863,752
差入委託証拠金	18,114,231
(B) 負債	118,700,970
未払解約金	107,470,059
未払信託報酬	11,161,702
未払利息	60
その他未払費用	69,149
(C) 純資産総額(A－B)	2,970,297,820
元本	2,428,058,940
次期繰越損益金	542,238,880
(D) 受益権総口数	2,428,058,940口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,233円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,370,275,180円
 期中追加設定元本額 6,744,721,290円
 期中一部解約元本額 5,686,937,530円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,233円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年5月13日～ 2017年5月12日
費用控除後の配当等収益額	52,759,283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	135,332,188円
収益調整金額	349,239,131円
分配準備積立金額	4,908,278円
当ファンドの分配対象収益額	542,238,880円
1万口当たり収益分配対象額	2,233円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況 (2016年5月13日～2017年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 26,857
受取利息	5,487
支払利息	△ 32,344
(B) 有価証券売買損益	202,042,944
売買益	383,637,244
売買損	△181,594,300
(C) 先物取引等取引損益	6,191,244
取引益	6,191,244
(D) 信託報酬等	△ 17,804,764
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	190,402,567
(F) 前期繰越損益金	2,597,182
(G) 追加信託差損益金	349,239,131
(配当等相当額)	(275,042,616)
(売買損益相当額)	(74,196,515)
(H) 計(E＋F＋G)	542,238,880
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H＋I)	542,238,880
追加信託差損益金	349,239,131
(配当等相当額)	(284,166,036)
(売買損益相当額)	(65,073,095)
分配準備積立金	192,999,749

(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。

*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】

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年8月11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10期》決算日2017年5月12日

[計算期間：2016年5月13日～2017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10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10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 円	期 騰 落 中 率 %	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース)		株 式 組 入 比 率 %	株 先 物 比 率 %	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 %	純 資 産 総 額 百万円
			期 騰 落 中 率 %	期 騰 落 中 率 %				
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
10期(2017年5月12日)	15,753	18.6	352.04	16.0	94.3	4.8	2.4	85,648

(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 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2016年5月12日	円	%		%	%	%	%
	13,282	—	303.60	—	88.4	10.2	2.5
5月末	13,597	2.4	310.03	2.1	90.4	10.1	2.5
6月末	13,329	0.4	303.46	△ 0.0	83.8	6.3	2.5
7月末	13,991	5.3	318.26	4.8	85.9	12.3	2.5
8月末	14,090	6.1	319.70	5.3	85.8	12.1	2.5
9月末	14,004	5.4	317.40	4.5	87.5	7.8	2.5
10月末	13,905	4.7	314.89	3.7	89.7	10.0	2.4
11月末	14,237	7.2	321.59	5.9	96.7	7.1	2.5
12月末	14,663	10.4	330.41	8.8	86.3	12.3	2.3
2017年1月末	14,820	11.6	333.95	10.0	87.3	7.7	2.3
2月末	15,302	15.2	344.05	13.3	86.3	10.4	2.3
3月末	15,462	16.4	346.89	14.3	87.5	9.5	2.3
4月末	15,630	17.7	349.95	15.3	88.9	8.5	2.3
(期 末) 2017年5月12日	15,753	18.6	352.04	16.0	94.3	4.8	2.4

(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

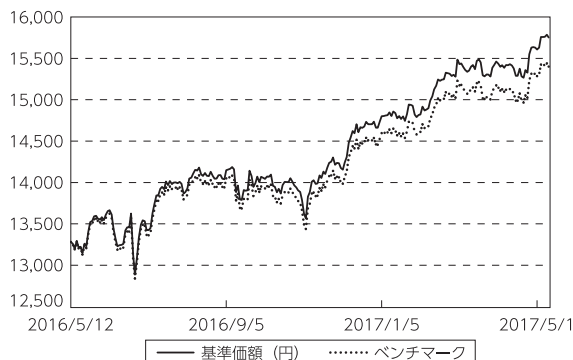
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.6%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(16.0%)を2.6%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

- ・米国の堅調な企業決算発表や米国大統領選挙結果を受けた今後の政策期待などから、外国株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは16.0%の上昇となったため、カイ離は2.6%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	△0.1%程度	△0.1%程度	2.8%程度	2.6%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.1%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.8%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計 3.0%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

(2016年5月13日～2017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 1	% 0.008	(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)	(0.004)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.004	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.004)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	5	0.033	(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)	(5)	(0.033)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	7	0.045	
期中の平均基準価額は、14,419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

(2016年5月13日～2017年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 6,395 (419)	千アメリカドル 34,545 (553)	百株 16,475 (527)	千アメリカドル 98,941 (2,921)
	カナダ	917 (151)	千カナダドル 3,784 (ー)	1,856	千カナダドル 7,381
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	606 (355)	2,375 (△ 122)	1,396	5,150
	イタリア	1,590 (△ 817)	823 (△ 87)	3,485	1,159
	フランス	484 (167)	1,973 (△ 145)	1,306	4,666
	オランダ	433 (134)	757 (266)	1,058	1,952
	スペイン	1,496 (13,160)	670 (127)	15,381	1,682
	ベルギー	24 (△ 25)	220 (△ 240)	90	700
	オーストリア	9 (ー)	24 (△ 3)	27	81
	ルクセンブルク	81	170	119	134
	フィンランド	138	139	400	468
	アイルランド	552	66	1,491	200
	ポルトガル	63	26	10,470	90
	イギリス	58 (48)	205 (114)	58	188
	イギリス	6,645 (51,223)	千イギリスポンド 3,429 (54)	14,082 (55,555)	千イギリスポンド 9,094 (512)
	スイス	230 (ー)	千スイスフラン 1,485 (△ 306)	808	千スイスフラン 5,155
	スウェーデン	337 (151)	千スウェーデンクローネ 4,616 (ー)	1,139 (58)	千スウェーデンクローネ 14,142 (105)
	ノルウェー	186 (ー)	千ノルウェークローネ 2,278 (△ 77)	271	千ノルウェークローネ 3,053

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 123 (24)	千デンマーククローネ 3,637 (ー)	百株 260	千デンマーククローネ 7,156
	オーストラリア	1,147 (100)	千オーストラリアドル 1,695 (ー)	3,614 (148)	千オーストラリアドル 5,046 (131)
	ニュージーランド	326	千ニュージーランドドル 169	280	千ニュージーランドドル 142
	香港	2,422 (202)	千香港ドル 5,807 (ー)	4,416	千香港ドル 14,393
	シンガポール	1,891 (1,188)	千シンガポールドル 395 (ー)	4,742 (1,188)	千シンガポールドル 996 (9)
	イスラエル	168	千イスラエルシェケル 792	513	千イスラエルシェケル 4,388

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HCP INC	0.644	25	2	59
	MACERICH CO/THE	0.162	13	0.843	59
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	197	0.2	21
	PROLOGIS INC	0.672	35	2	114
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.13	11	0.385	30
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	149	0.3	12
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.502	49	0.672	63
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.093	21	0.312	68
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.355	30	0.527	37
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.133	21	0.303	42
	WELLTOWER INC	0.631	47	1	98
	BOSTON PROPERTIES INC	0.205	28	0.679	83
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.7	64	0.1	9
	REALTY INCOME CORP	0.495	32	1	60
	REGENCY CENTERS CORP	1	91	0.279	18
	SL GREEN REALTY CORP	0.211	24	0.446	46
	UDR INC	0.492	17	1	40
	VENTAS INC	0.651	46	1	71
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	4	46	5	56
	WEYERHAEUSER CO	—	—	3	102
	AMERICAN TOWER CORP	0.607	68	1	195
	AGNC INVESTMENT CORP	—	—	1	26
	VEREIT INC	3	40	5	46
	DUKE REALTY CORP	0.675	18	1	35
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3	98	1	32
	IRON MOUNTAIN INC	1	57	1	35
	EQUINIX INC	0.167	61	0.261	90
	CROWN CASTLE INTL CORP	1	102	1	131
	QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	2	30
		(2)	(—)		
	PARK HOTELS & RESORTS INC	—	—	2	76
		(2)	(62)		
	EQUITY RESIDENTIAL	0.49	31	1	97
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	11	169	—	—
	GGP INC	0.744	21	2	61
	HOST HOTELS & RESORTS INC	0.806	14	3	60
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.277	11	0.759	29
	PUBLIC STORAGE	0.207	46	0.663	141
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.424	91	1	227
	VORNADO REALTY TRUST	0.238	24	0.758	75
	KIMCO REALTY CORP	0.646	19	1	44

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		0.187	32	0.603	101
	小計		44 (5)	1,866 (62)	55	2,640
	カナダ			千カナダドル		千カナダドル
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT		—	—	0.3	9
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		—	—	0.5	11
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		—	—	0.4	10
	小計		—	—	1	31
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
	フランス					
	GECINA SA		0.232	30	0.206	25
	KLEPIERRE		0.29	12	0.968	34
	UNIBAIL-RODAMCO SE		0.15	36	0.444	94
	FONCIERE DES REGIONS		0.21 (—)	17 (△0.90435)	0.159	11
	ICADE		0.1	6	0.117	7
	小計		0.982 (—)	103 (△0.90435)	1	174
	ユーロ計		0.982 (—)	103 (△0.90435)	1	174
	イギリス			千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC		5	38	4	25
	HAMMERSON PLC		1	8	3	20
	LAND SECURITIES GROUP PLC		0.904	9	3	33
	INTU PROPERTIES PLC		—	—	2	7
	SEGRO PLC		1	8	2	8
	SEGRO PLC -RTS		— (3)	— (—)	3	3
	小計		9 (3)	65 (—)	19	99
	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		4	14	15	45
	SCENTRE GROUP		8	42	25	113
	GPT GROUP		2	14	8	42
	MIRVAC GROUP		6	14	18	38
	STOCKLAND		3	14	9	44
	WESTFIELD CORP		2	25	8	80
	DEXUS		1	14	4	44
	GOODMAN GROUP		2	17	7	52
	小計		31	160	99	461
	香港			千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT		3	169	11	585
	小計		3	169	11	585

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	— (—)	— (△0.52381)	9	15
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	8	11
	CAPITALAND MALL TRUST	—	—	7	15
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	6 (—)	16 (△0.31161)	6	15
	小 計	6 (—)	16 (△0.83542)	32	58

(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 64,755	百万円 71,055	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

(2016年5月13日～2017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	22,878,006千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	77,889,794千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29

(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

(2016年5月13日～2017年5月12日)

利害関係人との取引状況

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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 1,016,900	百万円 666,486	% 65.5	百万円 1,015,289	百万円 664,989	% 65.5
為替直物取引	3,799	1,433	37.7	18,844	17,690	93.9

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

○組入資産の明細

(2017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		327	—	—	—	素材
AMERICAN EXPRESS CO		209	170	1,329	151,488	各種金融
ABBOTT LABORATORIES		373	377	1,654	188,537	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC		82	71	401	45,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP		13	11	180	20,579	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING		115	98	954	108,730	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC		18	14	59	6,778	小売
AES CORP		170	146	168	19,207	公益事業
AFLAC INC		106	89	661	75,379	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		309	225	1,392	158,703	保険
APACHE CORP		94	83	424	48,401	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES		—	173	191	21,820	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		15	11	287	32,787	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A		156	135	1,638	186,652	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC		51	44	646	73,679	素材
ANTHEM INC		65	57	1,054	120,105	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP		127	122	631	71,967	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP		336	298	787	89,678	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC		136	107	604	68,898	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE		159	128	2,363	269,332	資本財
BECTON DICKINSON AND CO		52	46	857	97,647	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC		77	61	322	36,707	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		417	365	2,017	229,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC		30	26	1,021	116,345	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		1,018	893	4,113	468,639	電気通信サービス
CR BARD INC		18	16	497	56,639	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP		27	36	290	33,124	素材
BAKER HUGHES INC		91	87	521	59,387	エネルギー
ALLSTATE CORP		96	80	674	76,810	保険
AVERY DENNISON CORP		22	19	162	18,562	素材
CHUBB LTD		115	101	1,395	158,979	保険
ANALOG DEVICES INC		78	79	623	70,990	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC		7	6	437	49,885	小売
CVS HEALTH CORP		277	233	1,921	218,887	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES		53	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CORNING INC		296	208	600	68,471	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO		921	784	6,836	778,958	銀行
CIGNA CORP		64	56	921	104,975	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC		145	128	1,299	148,104	資本財
COCA-COLA CO/THE		1,033	897	3,919	446,584	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		133	105	849	96,777	各種金融
CAMPBELL SOUP CO		46	43	253	28,831	食品・飲料・タバコ
CSX CORP		244	205	1,071	122,113	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A		50	—	—	—	メディア
CHEVRON CORP		471	413	4,396	500,992	エネルギー
COACH INC		69	61	278	31,789	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		32	35	369	42,057	資本財
CONOCOPHILLIPS		309	271	1,286	146,589	エネルギー
CME GROUP INC		80	74	864	98,472	各種金融
CARDINAL HEALTH INC		82	69	508	57,989	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		213	185	1,328	151,391	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC		149	138	1,072	122,164	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE		281	245	1,519	173,142	素材
DEVON ENERGY CORP		115	103	392	44,701	エネルギー
DEERE & CO		78	58	664	75,672	資本財
DANAHER CORP		154	136	1,128	128,529	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS		219	190	1,503	171,333	素材
WALT DISNEY CO/THE		393	331	3,630	413,621	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC		28	25	221	25,290	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP		172	151	1,256	143,150	公益事業
DR HORTON INC		84	77	257	29,319	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC		22	19	95	10,922	小売
TARGET CORP		146	116	655	74,727	小売
DUN & BRADSTREET CORP		9	7	87	9,972	商業・専門サービス
DAVITA INC		42	35	236	26,968	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP		38	34	271	30,967	資本財
DTE ENERGY COMPANY		45	39	416	47,447	公益事業
EXXON MOBIL CORP		1,042	909	7,509	855,679	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		53	46	514	58,676	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC		137	126	1,190	135,664	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO		163	140	819	93,324	資本財
EXELON CORP		231	202	679	77,416	公益事業
ECOLAB INC		66	57	728	82,970	素材
EQUIFAX INC		29	26	354	40,401	商業・専門サービス
EMC CORP/MA		485	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		55	48	448	51,146	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC		115	98	758	86,477	資本財
EDISON INTERNATIONAL		82	71	565	64,402	公益事業
ENTERGY CORP		45	39	299	34,123	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD		10	8	214	24,395	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO		15	12	92	10,513	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC		115	102	1,383	157,596	公益事業
MACY'S INC		78	67	164	18,755	小売
FEDEX CORP		67	55	1,054	120,180	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC		57	—	—	—	エネルギー
FORD MOTOR CO		927	812	894	101,895	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC		97	81	354	40,414	各種金融
FOOT LOCKER INC		34	29	223	25,507	小売
FIRSTENERGY CORP		106	94	270	30,869	公益事業
FLUOR CORP		35	30	145	16,608	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC		289	284	331	37,819	素材
GENERAL MILLS INC		149	129	728	82,980	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP		67	56	1,105	126,009	資本財
WW GRAINGER INC		14	12	230	26,282	資本財
GENERAL ELECTRIC CO		2,362	1,939	5,597	637,830	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC		32	33	298	33,976	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO		37	32	299	34,075	小売
TEGNA INC		52	44	102	11,691	メディア

銘柄	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	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO		67	57	203	23,165	自動車・自動車部品
GAP INC/THE		60	52	134	15,338	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC		96	78	1,766	201,236	各種金融
HALLIBURTON CO		210	190	867	98,796	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		183	158	2,093	238,520	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC		48	39	217	24,825	自動車・自動車部品
HP INC		450	374	721	82,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		102	82	410	46,821	保険
HERSHEY CO/THE		37	31	337	38,496	食品・飲料・タバコ
HARMAN INTERNATIONAL		17	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC		317	267	4,171	475,315	小売
HASBRO INC		28	24	250	28,531	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC		65	56	499	56,867	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP		230	198	2,983	339,902	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO		98	85	449	51,241	素材
ILLINOIS TOOL WORKS		81	69	955	108,886	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		101	87	215	24,578	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		20	17	227	25,956	素材
JOHNSON & JOHNSON		692	596	7,343	836,741	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC		162	—	—	—	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN		27	23	215	24,532	運輸
KELLOGG CO		66	57	406	46,337	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP		90	78	1,009	115,052	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		397	338	1,511	172,227	食品・飲料・タバコ
KROGER CO		231	197	600	68,466	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP		48	38	143	16,339	小売
ELI LILLY & CO		249	217	1,744	198,809	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		25	22	318	36,245	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		41	34	201	22,967	運輸
LENNAR CORP-A		44	44	228	26,056	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC		229	190	1,615	184,097	小売
LEGGETT & PLATT INC		34	29	155	17,728	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC		61	53	272	31,060	小売
LAS VEGAS SANDS CORP		99	95	549	62,608	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP		69	57	1,573	179,253	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP		61	50	339	38,659	保険
L3 TECHNOLOGIES INC		19	16	284	32,472	資本財
LEGG MASON INC		24	—	—	—	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		51	72	745	84,924	消費者サービス
MCDONALD'S CORP		229	181	2,623	298,901	消費者サービス
S&P GLOBAL INC		67	56	782	89,102	各種金融
MEDTRONIC PLC		353	305	2,534	288,729	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.		699	604	3,892	443,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC		271	227	660	75,256	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC		84	74	166	19,025	耐久消費財・アパレル
3M CO		154	131	2,591	295,308	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC		39	33	282	32,163	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL		112	102	316	36,015	消費者サービス
MASCO CORP		84	72	266	30,337	資本財
MONSANTO CO		110	95	1,110	126,485	素材
M & T BANK CORP		35	30	481	54,912	銀行
MARSH & MCLENNAN COS		130	112	830	94,604	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	
MOHAWK INDUSTRIES INC		15	13	323	36,894	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY		363	308	1,322	150,699	各種金融
MCKESSON CORP		57	49	720	82,142	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC		236	204	1,055	120,208	保険
MANPOWERGROUP INC		18	15	154	17,637	商業・専門サービス
MOODY'S CORP		44	38	439	50,117	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP		74	63	744	84,775	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,606	2,606	2,215	5,332	607,614	銀行
NISOURCE INC		—	72	175	19,982	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP		43	36	907	103,446	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		121	107	139	15,937	銀行
NEWMONT MINING CORP		132	116	388	44,307	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A		292	232	663	75,601	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		29	25	251	28,690	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP		3	3	295	33,643	保険
NUCOR CORP		79	69	400	45,576	素材
NEWELL BRANDS INC		112	94	507	57,860	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B		110	94	267	30,499	メディア
NOBLE ENERGY INC		107	94	295	33,684	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		191	167	1,022	116,489	エネルギー
OMNICOM GROUP		60	51	435	49,626	メディア
PEPSICO INC		364	314	3,551	404,682	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA		24	20	211	24,126	素材
ALTRIA GROUP INC		490	427	3,015	343,568	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL		28	24	209	23,913	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE		680	560	4,828	550,153	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		126	106	1,298	147,976	銀行
PFIZER INC	1,545	1,545	1,329	4,393	500,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		112	94	1,018	116,048	保険
PULTEGROUP INC		78	64	148	16,894	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP		34	29	465	53,091	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		40	37	636	72,492	エネルギー
CITIGROUP INC		745	624	3,792	432,149	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		73	62	399	45,545	保険
PPG INDUSTRIES INC		67	57	619	70,562	素材
PENTAIR PLC		45	37	245	27,983	資本財
PRAXAIR INC		71	62	806	91,854	素材
P G & E CORP		120	112	738	84,189	公益事業
PPL CORP		169	149	577	65,807	公益事業
PROGRESSIVE CORP		146	127	512	58,374	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		127	111	477	54,370	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS		35	—	—	—	消費者サービス
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		44	37	408	46,528	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY		75	64	1,025	116,817	資本財
REPUBLIC SERVICES INC		60	52	332	37,881	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP		325	269	382	43,584	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		10	9	124	14,174	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC		25	22	494	56,354	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC		104	91	250	28,549	公益事業
ROBERT HALF INTL INC		33	28	135	15,463	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC		33	28	444	50,618	資本財
SCHLUMBERGER LTD		345	304	2,185	249,030	エネルギー

銘柄	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	
STRYKER CORP		84	73	995	113,445	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP		296	262	1,050	119,669	各種金融
SEMPRA ENERGY		59	52	583	66,429	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		19	17	582	66,382	素材
ST JUDE MEDICAL INC		70	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		37	32	454	51,737	資本財
SUNTRUST BANKS INC		127	107	609	69,476	銀行
TRAVELERS COS INC/THE		76	62	751	85,578	保険
SOUTHERN CO/THE		228	216	1,077	122,744	公益事業
AT&T INC		1,539	1,346	5,175	589,664	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP		48	62	558	63,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP		100	84	699	79,710	各種金融
SYSCO CORP		141	114	627	71,465	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP		49	41	180	20,575	素材
SCANA CORP		34	30	198	22,646	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC		253	218	1,757	200,272	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO		32	27	251	28,665	小売
TORCHMARK CORP		30	24	188	21,434	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		105	206	863	98,379	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		99	86	1,483	169,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC		68	59	286	32,673	資本財
UNION PACIFIC CORP		213	180	1,988	226,609	運輸
UNUM GROUP		60	51	237	27,030	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP		210	171	2,078	236,782	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC		238	208	3,615	411,964	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP		437	372	1,922	219,091	銀行
MARATHON OIL CORP		205	185	268	30,649	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		174	151	1,577	179,759	運輸
VALERO ENERGY CORP		120	99	659	75,138	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		24	20	198	22,607	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE		—	16	179	20,472	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		108	86	539	61,502	メディア
VF CORP		85	72	398	45,415	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO		33	29	376	42,873	素材
WILLIAMS COS INC		178	178	541	61,650	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		217	201	1,721	196,191	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC		79	69	422	48,190	公益事業
WAL-MART STORES INC		401	338	2,576	293,562	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO		1,214	1,045	5,620	640,357	銀行
WASTE MANAGEMENT INC		111	96	702	80,026	商業・専門サービス
WATERS CORP		20	17	304	34,673	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL		220	203	104	11,852	エネルギー
WHIRLPOOL CORP		19	16	306	34,965	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP		227	189	134	15,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XL GROUP PLC		74	—	—	—	保険
XCEL ENERGY INC		128	112	507	57,802	公益事業
KEYCORP		174	236	431	49,188	銀行
CARMAX INC		50	42	249	28,442	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		47	43	531	60,561	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC		42	34	127	14,581	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC		107	76	528	60,225	消費者サービス
TJX COMPANIES INC		167	142	1,134	129,239	小売

銘柄	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	
CA INC		82	68	219	25,003	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY		32	28	376	42,929	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A		36	31	272	31,052	素材
CADENCE DESIGN SYS INC		—	62	204	23,305	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP		103	76	473	54,004	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		70	68	570	64,991	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC		108	91	342	39,051	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC		74	67	533	60,831	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP		198	164	403	45,925	銀行
STERICYCLE INC		21	18	158	18,029	商業・専門サービス
INTEL CORP		1,181	1,038	3,705	422,255	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC		1,270	1,098	3,695	421,099	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP		22	18	223	25,453	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP		31	27	350	39,888	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP		109	95	1,642	187,113	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC		300	236	1,028	117,204	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC		77	65	714	81,405	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A		73	63	369	42,145	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP		168	137	431	49,151	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC		102	86	562	64,125	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		42	47	373	42,525	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B		339	292	1,588	181,027	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS		2	3	35	3,994	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC		188	163	2,609	297,358	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC		44	38	268	30,601	銀行
NORTHERN TRUST CORP		54	47	425	48,455	各種金融
MICROSOFT CORP		1,899	1,619	11,084	1,263,022	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC		22	19	228	26,077	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP		35	37	285	32,566	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC		160	142	134	15,293	小売
STARBUCKS CORP		371	318	1,921	218,932	消費者サービス
ORACLE CORP		800	674	3,047	347,261	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC		85	69	258	29,445	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC		101	93	1,488	169,603	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		24	20	532	60,649	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC		128	129	723	82,450	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC		47	41	421	48,004	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC		20	17	310	35,334	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY		33	29	176	20,124	小売
LAM RESEARCH CORP		40	35	536	61,084	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD		20	17	218	24,915	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A		621	1,044	4,101	467,283	メディア
XILINX INC		64	55	358	40,823	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC		88	76	493	56,283	資本財
DENTSPLY SIRONA INC		60	50	313	35,763	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC		—	16	219	25,059	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC		360	288	1,927	219,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC		38	34	296	33,835	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		9	8	713	81,252	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC		62	53	675	76,924	ソフトウェア・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC		62	60	116	13,255	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC		81	70	405	46,187	ソフトウェア・サービス

銘柄	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	
YAHOO! INC		224	199	990	112,842	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC		21	18	80	9,218	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK		12	11	163	18,651	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH		17	28	296	33,728	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC		56	43	417	47,604	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A		63	54	165	18,838	メディア
SALESFORCE.COM INC		157	141	1,236	140,930	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC		34	28	131	15,037	小売
ALPHABET INC-CL A		72	64	6,204	706,961	ソフトウェア・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP		11	9	116	13,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC		26	—	—	—	資本財
GARMIN LTD		28	26	136	15,570	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC		62	54	195	22,218	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC		376	323	1,770	201,741	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC		60	55	239	27,340	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC		38	32	245	27,974	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP		59	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		71	62	283	32,334	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC		99	88	8,391	956,090	小売
T ROWE PRICE GROUP INC		62	53	380	43,302	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC		35	30	328	37,424	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP		32	34	343	39,103	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP		73	59	209	23,833	各種金融
CERNER CORP		77	66	432	49,230	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD		97	88	2,038	232,260	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC		37	33	190	21,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC		25	20	181	20,703	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC		75	66	394	44,946	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC		26	39	357	40,743	商業・専門サービス
EBAY INC		270	232	793	90,457	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP		134	118	1,495	170,409	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC		55	51	420	47,966	小売
PRICELINE GROUP INC/THE		12	10	1,962	223,581	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		296	268	4,381	499,229	各種金融
BB&T CORP		201	178	766	87,319	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		273	231	1,088	124,017	各種金融
BORGWARNER INC		56	47	196	22,419	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC		58	48	128	14,627	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE		29	25	318	36,273	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC		200	169	1,670	190,324	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP		48	36	322	36,732	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC		16	12	128	14,596	保険
AETNA INC		86	76	1,109	126,464	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION		61	53	293	33,476	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER		123	108	731	83,362	公益事業
AON PLC		68	57	715	81,520	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		149	125	528	60,239	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		23	18	119	13,577	保険
HESS CORP		70	62	310	35,375	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC		87	75	230	26,317	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP		67	57	217	24,809	各種金融
RED HAT INC		45	39	351	40,085	ソフトウェア・サービス

銘柄	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	
F5 NETWORKS INC		17	14	188	21,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A		56	49	306	34,935	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		44	38	190	21,731	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC		73	60	244	27,838	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP		41	37	432	49,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		103	95	149	17,026	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC		55	47	1,212	138,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC		36	32	583	66,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC		124	109	1,486	169,420	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		61	54	626	71,398	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		—	200	640	72,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC		41	33	124	14,130	小売
CELGENE CORP		196	169	2,029	231,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		152	132	853	97,298	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO		169	135	820	93,458	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC		46	39	211	24,043	運輸
FASTENAL CO		68	63	284	32,395	資本財
FISERV INC		57	47	570	64,951	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD		139	120	195	22,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC		524	380	183	20,920	メディア
SANDISK CORP		50	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	1,395	1,168	17,994	2,050,287	2,050,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP		38	34	236	26,901	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC		198	237	303	34,591	銀行
COSTAR GROUP INC		—	7	177	20,169	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		56	49	584	66,623	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC		15	—	—	—	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		36	31	218	24,853	運輸
CENTURYLINK INC		137	119	292	33,277	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC		34	29	110	12,536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV		104	99	392	44,742	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC		52	46	237	27,029	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC		214	187	1,221	139,232	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY		74	64	272	31,078	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD		35	30	214	24,418	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC		18	16	235	26,840	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC		93	82	279	31,891	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A		43	38	691	78,799	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO		—	43	151	17,272	エネルギー
COOPER COS INC/THE		12	10	221	25,214	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP		38	37	214	24,489	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A		77	67	491	55,984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP		24	21	142	16,259	保険
AGCO CORP		17	14	92	10,527	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A		37	34	89	10,203	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP		35	87	419	47,762	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC		30	27	378	43,074	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		58	51	139	15,870	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	149	132	390	44,537	44,537	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC		43	34	443	50,503	各種金融
TESORO CORP		30	26	213	24,297	エネルギー
FNF GROUP		62	53	217	24,831	保険

銘柄	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	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		29	130	769	87,657	各種金融
NASDAQ INC		28	25	169	19,295	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		37	40	84	9,633	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B		87	76	262	29,963	メディア
AUTOLIV INC		22	19	198	22,608	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A		75	66	231	26,351	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		7	6	311	35,456	消費者サービス
IHS INC-CLASS A		17	—	—	—	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		28	46	229	26,182	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A		111	93	220	25,156	小売
ARROW ELECTRONICS INC		23	20	153	17,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC		42	35	555	63,347	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		30	26	144	16,504	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP		81	71	180	20,597	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		14	13	308	35,184	素材
RANGE RESOURCES CORP		42	39	101	11,580	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO		96	108	81	9,265	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO		23	20	246	28,072	エネルギー
RALPH LAUREN CORP		14	12	97	11,139	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP		29	50	200	22,841	公益事業
OCEANEERING INTL INC		24	—	—	—	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		29	23	224	25,621	消費者サービス
HANESBRANDS INC		98	82	184	21,044	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A		247	211	2,458	280,167	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO		126	106	207	23,678	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV		22	33	148	16,905	資本財
AVNET INC		33	27	105	11,977	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE		79	72	172	19,664	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		20	40	86	9,830	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP		168	—	—	—	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC		13	11	284	32,441	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO		—	26	184	20,974	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		32	28	402	45,855	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		76	66	114	13,078	銀行
TE CONNECTIVITY LTD		96	77	595	67,839	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		107	86	522	59,577	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC		28	24	131	14,936	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC		13	11	136	15,595	資本財
MERCADOLIBRE INC		—	9	252	28,802	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A		19	14	137	15,658	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP		70	62	288	32,866	保険
TIME WARNER CABLE		70	—	—	—	メディア
SEATTLE GENETICS INC		—	22	136	15,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC		15	12	388	44,286	小売
LKQ CORP		76	67	209	23,833	小売
HORMEL FOODS CORP		72	63	218	24,924	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR		—	17	133	15,251	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO		37	32	252	28,721	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A		26	—	—	—	小売
HARRIS CORP		31	27	298	33,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC		37	32	753	85,887	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP		41	36	97	11,055	エネルギー

銘柄	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	
NRG ENERGY INC		79	—	—	—	公益事業
INVESCO LTD		106	89	289	32,950	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		40	37	334	38,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY		35	30	154	17,584	各種金融
TERADATA CORP		33	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		41	36	210	23,948	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC		32	31	423	48,291	エネルギー
MSCI INC		24	19	186	21,276	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		23	20	86	9,853	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B		46	41	385	43,887	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		387	339	3,777	430,403	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES		487	409	3,770	429,608	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC		47	39	362	41,273	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.		10	9	104	11,863	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP		114	102	253	28,918	エネルギー
FLOWSERVE CORP		32	28	141	16,084	資本財
HELMERICH & PAYNE		26	23	138	15,798	エネルギー
T-MOBILE US INC		71	63	414	47,262	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		18	17	122	13,968	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C		69	48	125	14,327	メディア
RESMED INC		34	30	210	23,970	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC		20	18	205	23,426	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC		59	50	305	34,771	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD		30	26	255	29,117	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC		32	56	284	32,359	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		23	19	170	19,437	運輸
PERRIGO CO PLC		36	31	236	26,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC		39	—	—	—	資本財
FMC CORP		33	29	215	24,592	素材
WABTEC CORP		24	19	159	18,164	資本財
EVERSOURCE ENERGY		80	70	418	47,656	公益事業
NETSUITE INC		10	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC		—	16	190	21,675	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC		98	82	1,899	216,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC		13	—	—	—	素材
CROWN HOLDINGS INC		35	30	174	19,930	素材
CALPINE CORP		86	74	93	10,613	公益事業
EATON VANCE CORP		28	24	109	12,481	各種金融
DELTA AIR LINES INC		50	41	208	23,767	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO		49	40	361	41,171	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC		45	39	300	34,208	公益事業
VERISK ANALYTICS INC		40	34	269	30,664	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP		73	61	444	50,626	小売
FORTINET INC		36	31	124	14,168	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS		23	18	140	15,962	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		6	5	321	36,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC		42	44	206	23,560	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP		292	253	30	3,463	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO		353	301	1,028	117,135	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV		34	65	694	79,141	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A		95	75	622	70,888	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		—	10	195	22,284	資本財

銘柄	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	
HCA HEALTHCARE INC		81	65	561	63,953	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC		95	—	—	—	運輸
HOLLYFRONTIER CORP		43	36	102	11,666	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		133	115	608	69,330	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP		26	23	185	21,171	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		39	33	212	24,246	資本財
DEXCOM INC		—	19	130	14,924	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP		—	12	161	18,374	資本財
XYLEM INC		44	39	199	22,719	資本財
TRIPADVISOR INC		29	26	119	13,637	小売
MEDIVATION INC		41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		15	13	206	23,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		36	33	308	35,170	銀行
ALLEGHANY CORP		3	3	194	22,181	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS		19	16	748	85,260	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66		133	103	820	93,459	エネルギー
FACEBOOK INC-A		568	513	7,700	877,361	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP		70	62	282	32,244	公益事業
ALBEMARLE CORP		28	24	272	31,052	素材
PVH CORP		20	17	178	20,354	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A		28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC		475	416	836	95,319	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC		86	78	318	36,339	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC		70	59	519	59,219	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A		21	—	—	—	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		42	37	150	17,091	資本財
SPLUNK INC		32	29	196	22,375	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP		51	44	151	17,219	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC		15	13	123	14,024	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC		409	356	2,329	265,379	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC		24	28	911	103,889	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC		56	44	208	23,788	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP		36	—	—	—	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		32	27	209	23,851	各種金融
ZOETIS INC		118	103	616	70,222	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC		29	23	108	12,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A		95	82	104	11,940	メディア
SPRINT CORP		199	174	137	15,635	電気通信サービス
TECO ENERGY INC		59	—	—	—	公益事業
SNAP-ON INC		14	12	217	24,829	資本財
AGL RESOURCES INC		25	—	—	—	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD		46	35	130	14,860	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC		145	124	228	26,018	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A		39	35	222	25,310	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		28	26	240	27,381	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC		37	36	349	39,810	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		22	19	243	27,780	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV		23	—	—	—	資本財
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		19	20	277	31,578	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS		46	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C		77	68	6,335	721,869	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC		41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	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	
NAVIENT CORP		90	65	93	10,680	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC		53	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC		23	18	210	23,951	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		40	29	138	15,738	運輸
VOYA FINANCIAL INC		53	42	154	17,586	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP		11	—	—	—	素材
ANTERO RESOURCES CORP		20	34	71	8,162	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC		23	32	270	30,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC		108	92	174	19,856	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		123	43	269	30,748	消費者サービス
CDK GLOBAL INC		34	28	175	20,021	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		—	19	192	21,947	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C		—	24	204	23,355	メディア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		40	34	185	21,079	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC		20	20	232	26,450	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD		18	13	80	9,157	小売
SYNCHRONY FINANCIAL		208	180	486	55,464	各種金融
QORVO INC		35	28	187	21,404	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC		30	—	—	—	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	38	214	24,428	保険
ACUITY BRANDS INC		10	9	181	20,670	資本財
JONES LANG LASALLE INC		11	9	114	13,070	不動産
ARAMARK		56	50	189	21,540	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP		131	111	413	47,086	銀行
LEAR CORP		18	15	226	25,862	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		19	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHITEWAVE FOODS CO		44	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		35	47	149	17,037	素材
RITE AID CORP		219	230	92	10,550	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP		—	40	203	23,193	エネルギー
BAXALTA INC		170	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLUMBIA PIPELINE GROUP		97	—	—	—	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C		—	24	49	5,630	メディア
WESTROCK CO		64	55	298	34,028	素材
KRAFT HEINZ CO/THE		151	133	1,190	135,630	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC		275	237	1,181	134,667	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A		13	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C		25	24	107	12,299	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS		451	366	691	78,804	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV		20	39	240	27,399	ソフトウェア・サービス
AMERCO		1	1	55	6,361	運輸
CDW CORP/DE		35	32	193	22,096	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC		23	20	114	13,052	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP		51	46	112	12,863	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A		—	71	117	13,358	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO		18	15	104	11,956	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		37	41	79	9,086	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		50	43	160	18,305	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		22	20	76	8,763	メディア
DOMINO'S PIZZA INC		—	11	214	24,487	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		—	47	1,541	175,646	メディア
IDEXX LABORATORIES INC		—	20	326	37,183	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	
SMITH (A. O.) CORP		—	32	173	19,728	資本財
UGI CORP		—	39	191	21,836	公益事業
WESTAR ENERGY INC		—	32	166	18,937	公益事業
FORTIVE CORP		—	68	425	48,517	資本財
IHS MARKIT LTD		—	78	342	39,066	商業・専門サービス
XL GROUP LTD		—	58	244	27,888	保険
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V		—	49	323	36,904	ソフトウェア・サービス
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC		—	13	166	18,969	素材
COTY INC-CL A		—	106	208	23,745	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC		—	96	262	29,874	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		—	48	153	17,490	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		—	14	174	19,851	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		—	6	78	8,890	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC		—	10	193	22,090	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		—	34	112	12,783	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE CORP		—	25	149	17,006	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC		—	98	309	35,242	エネルギー
DXC TECHNOLOGY CO		—	62	494	56,321	ソフトウェア・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		120	260	199	22,751	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		—	50	210	24,018	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		60	55	360	41,034	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	78,527	68,340	460,977	52,523,771	
	銘柄 数 < 比 率 >	596	596	—	<61.3%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA		371	325	3,014	250,584	銀行
IMPERIAL OIL LTD		75	66	260	21,688	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP		86	71	428	35,584	各種金融
TRANSCANADA CORP		178	190	1,204	100,122	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		91	79	492	40,914	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC		153	134	623	51,842	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B		142	124	307	25,564	素材
BARRICK GOLD CORP		291	255	583	48,480	素材
BCE INC		36	32	196	16,314	電気通信サービス
AGRIUM INC		33	29	361	30,083	素材
BOMBARDIER INC-B		487	427	94	7,844	資本財
BANK OF MONTREAL		160	141	1,332	110,743	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		221	196	1,022	84,970	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA		301	265	2,008	166,961	銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE		81	72	135	11,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC		68	56	120	10,004	資本財
CAMECO CORP		100	89	119	9,965	エネルギー
CI FINANCIAL CORP		59	53	141	11,776	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		99	87	933	77,595	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		274	242	1,026	85,338	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO		199	168	1,701	141,473	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		18	15	234	19,501	小売
ENBRIDGE INC		230	356	1,949	162,087	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		6	5	303	25,188	保険
CGI GROUP INC - CLASS A		55	47	312	25,994	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC		88	77	125	10,422	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		25	21	83	6,913	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD		57	49	377	31,401	食品・生活必需品小売り

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	
MANULIFE FINANCIAL CORP		493	432	1,033	85,901	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC		101	83	507	42,206	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA		86	74	391	32,572	銀行
ONEX CORPORATION		21	18	180	15,014	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN		209	184	411	34,247	素材
POWER CORP OF CANADA		94	82	244	20,361	保険
POWER FINANCIAL CORP		63	55	181	15,106	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		102	91	261	21,718	メディア
SUNCOR ENERGY INC		396	365	1,577	131,140	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD		13	11	134	11,218	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		36	31	663	55,135	運輸
ENCANA CORP		211	216	336	27,939	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD		54	49	319	26,538	素材
FINNING INTERNATIONAL INC		43	38	101	8,447	資本財
GOLDCORP INC		208	187	361	30,064	素材
KINROSS GOLD CORP		308	265	148	12,380	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC		38	33	176	14,640	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC		75	65	223	18,566	保険
METHANEX CORP		23	20	115	9,593	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		252	222	80	6,680	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A		21	16	35	2,912	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC		58	48	187	15,589	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC		64	56	248	20,683	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD		125	111	142	11,848	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP		41	41	187	15,596	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		173	151	184	15,376	素材
YAMANA GOLD INC		237	222	82	6,828	素材
FORTIS INC		71	89	396	32,931	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		105	92	577	47,998	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP		179	152	76	6,317	素材
TORONTO-DOMINION BANK		464	407	2,581	214,574	銀行
FRANCO-NEVADA CORP		44	39	371	30,906	素材
SILVER WHEATON CORP		101	96	262	21,842	素材
EMPIRE CO LTD 'A'		41	34	71	5,935	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		26	22	119	9,919	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A		32	28	111	9,270	公益事業
METRO INC		60	50	230	19,161	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP		30	58	259	21,600	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP		33	29	268	22,359	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP		126	118	156	13,016	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		209	223	291	24,192	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		86	78	140	11,690	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP		47	50	141	11,754	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		93	87	379	31,554	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		28	26	127	10,586	エネルギー
DOLLARAMA INC		30	24	293	24,406	小売
KEYERA CORP		43	41	164	13,643	エネルギー
ALTAGAS LTD		37	36	110	9,211	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		38	36	94	7,822	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I		20	18	89	7,447	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC		28	27	53	4,473	不動産
INTER PIPELINE LTD		85	80	218	18,142	エネルギー

銘柄		株数	期首(前期末)	当期		業種等
				株数	評価額	
					外貨建金額	
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		46	46	136	11,375	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		41	52	136	11,368	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		5	4	273	22,750	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN		50	48	396	32,932	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD		17	14	80	6,653	素材
VERESEN INC		75	72	133	11,072	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B		7	6	181	15,112	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR		97	83	99	8,231	各種金融
LINAMAR CORP		12	10	63	5,306	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD		—	44	101	8,442	公益事業
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS		23	—	—	—	商業・専門サービス
EMERA INC		—	13	61	5,081	公益事業
小計	株数・金額	9,959	9,170	37,267	3,098,044	
	銘柄数<比率>	90	91	—	<3.6%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG		266	233	221	27,462	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		345	452	784	97,075	各種金融
METRO AG		44	39	115	14,303	食品・生活必需品小売り
SIEMENS AG-REG		198	167	2,194	271,673	資本財
RWE AG		123	108	168	20,877	公益事業
BASF SE		229	201	1,816	224,941	素材
VOLKSWAGEN AG		8	7	105	13,029	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		240	210	1,448	179,357	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		44	38	485	60,092	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE		502	441	318	39,384	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		82	72	653	80,849	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG		207	181	2,084	258,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG		46	40	679	84,147	素材
ALLIANZ SE-REG		114	100	1,738	215,253	保険
MAN SE		7	7	75	9,311	資本財
CONTINENTAL AG		27	24	503	62,272	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		282	247	472	58,485	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		38	33	179	22,182	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		60	52	88	10,902	運輸
HUGO BOSS AG -ORD		16	14	103	12,753	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG		242	212	674	83,560	運輸
SAP SE		245	214	2,020	250,076	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE		54	51	198	24,633	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG		48	42	394	48,837	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		54	47	404	50,085	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		10	9	67	8,338	運輸
ADIDAS AG		52	41	736	91,233	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		806	716	1,197	148,218	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		41	35	615	76,174	保険
THYSSENKRUPP AG		92	80	179	22,222	素材
BEIERSDORF AG		25	21	206	25,537	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG		35	32	279	34,663	素材
MERCK KGAA		32	28	316	39,131	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF		46	40	581	72,033	自動車・自動車部品
LANXESS AG		22	20	131	16,307	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA		95	89	704	87,217	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG		—	4	77	9,552	資本財

銘柄		株数	株数	当期		業種等
				期末		
				評価額	金額	
				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 WOHNEN AG-BR		84	77	261	32,337	不動産
GEA GROUP AG		45	40	149	18,475	資本財
SYMRISE AG		30	27	174	21,632	素材
K+S AG-REG		47	42	94	11,719	素材
HENKEL AG & CO KGAA		25	22	245	30,446	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		30	26	114	14,127	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		13	12	94	11,732	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE		15	13	141	17,542	保険
BRENNTAG AG		38	33	181	22,452	資本財
AXEL SPRINGER SE		11	10	54	6,702	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF		17	15	73	9,041	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		186	160	65	8,129	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG		22	18	126	15,714	資本財
VONOVIA SE		116	102	362	44,935	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG		34	35	109	13,563	素材
ZALANDO SE		21	18	73	9,159	小売
COVESTRO AG		—	16	106	13,164	素材
SCHAEFFLER AG		—	36	54	6,732	自動車・自動車部品
INNOGY SE		—	31	104	12,916	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,538	5,103	25,611	3,170,720	
		52	56	—	<3.7%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		291	256	380	47,072	保険
INTESA SANPAOLO		3,174	2,786	789	97,694	銀行
TELECOM ITALIA SPA		2,874	2,498	219	27,214	電気通信サービス
ENI SPA		636	557	830	102,868	エネルギー
UNICREDIT SPA		1,194	413	690	85,480	銀行
ENEL SPA		1,968	1,678	765	94,770	公益事業
SAIPEM SPA		1,524	1,333	53	6,600	エネルギー
ATLANTIA SPA		103	90	219	27,228	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP		230	196	52	6,471	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA		42	37	200	24,798	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA		140	123	113	14,091	銀行
SNAM SPA		533	540	229	28,407	エネルギー
TELECOM ITALIA-RSP		1,500	1,325	95	11,828	電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC		90	—	—	—	銀行
LEONARDO SPA		101	88	140	17,430	資本財
UBI BANCA SPA		226	—	—	—	銀行
TERNA SPA		387	340	167	20,732	公益事業
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		273	236	51	6,398	保険
PRYSMIAN SPA		48	42	109	13,609	資本財
EXOR SPA		27	—	—	—	各種金融
POSTE ITALIANE SPA		—	115	73	9,076	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,372	12,660	5,183	641,776	
		20	18	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)		46	39	483	59,865	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		69	61	1,425	176,443	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA		111	106	205	25,404	自動車・自動車部品
AXA SA		492	424	1,029	127,488	保険
DANONE		147	129	862	106,726	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA		138	124	273	33,900	食品・生活必需品小売り

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	
VIVENDI		290	225	414	51,361	メディア
INGENICO GROUP		13	12	102	12,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA		181	167	827	102,462	銀行
AIR LIQUIDE SA		86	85	964	119,390	素材
TOTAL SA		549	498	2,388	295,692	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		119	109	550	68,205	資本財
ZODIAC AEROSPACE		50	44	97	12,112	資本財
VINCI SA		120	110	861	106,623	資本財
SANOFI		294	254	2,328	288,291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		114	107	202	25,070	公益事業
L' OREAL		62	55	1,041	128,885	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA		53	37	157	19,501	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		139	122	867	107,409	資本財
BNP PARIBAS		265	245	1,632	202,044	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL		51	45	543	67,230	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI		40	35	341	42,324	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		14	12	66	8,208	食品・生活必需品小売り
VALEO SA		19	52	339	42,013	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL		6	5	255	31,653	耐久消費財・アパレル
SODEXO		23	20	239	29,678	消費者サービス
KERING		18	16	487	60,397	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		32	28	234	28,991	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA		26	—	—	—	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE		13	11	301	37,373	耐久消費財・アパレル
ATOS SE		21	19	244	30,306	ソフトウェア・サービス
ORANGE		496	436	646	80,083	電気通信サービス
CNP ASSURANCES		43	38	76	9,411	保険
IMERYS SA		8	7	60	7,512	素材
SAFRAN SA		78	68	518	64,213	資本財
RENAULT SA		48	42	370	45,846	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE		47	42	276	34,282	メディア
LAGARDERE SCA		29	26	71	8,822	メディア
JCDECAUX SA		18	15	46	5,718	メディア
SOCIETE BIC SA		7	6	68	8,540	商業・専門サービス
BOUYGUES SA		50	45	173	21,451	資本財
THALES SA		26	22	225	27,922	資本財
PERNOD RICARD SA		53	46	559	69,323	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA		264	246	349	43,251	銀行
ENGIE		367	352	487	60,342	公益事業
ALSTOM		38	34	103	12,817	資本財
ARKEMA		16	14	145	18,037	素材
LEGRAND SA		66	58	360	44,602	資本財
SCOR SE		38	35	126	15,627	保険
ADP		7	6	85	10,542	運輸
EDF		62	61	52	6,551	公益事業
NATIXIS		236	213	137	17,041	銀行
WENDEL		7	6	90	11,143	各種金融
BUREAU VERITAS SA		66	58	124	15,413	商業・専門サービス
EURAZEO		10	8	55	6,823	各種金融
SUEZ		76	78	129	16,082	公益事業
EIFFAGE		—	13	101	12,550	資本財
ILIAD SA		6	5	132	16,415	電気通信サービス

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	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
EUTELSAT COMMUNICATIONS		42	36	76	9,488	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		118	102	105	13,037	運輸
EDENRED		52	45	108	13,426	商業・専門サービス
REMY COINTREAU		6	5	50	6,229	食品・飲料・タバコ
REXEL SA		75	66	102	12,641	資本財
BOLLORE		219	194	76	9,494	運輸
SFR GROUP SA		27	20	64	8,041	電気通信サービス
DASSAULT AVIATION SA		—	0.5	65	8,092	資本財
SEB SA		—	5	75	9,384	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,333	5,679	26,073	3,227,943	
(ユーロ…オランダ)		64	66	—	<3.8%>	
QIAGEN N.V.		55	49	145	18,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV		237	224	219	27,216	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		224	197	197	24,395	自動車・自動車部品
FERRARI NV		32	27	205	25,403	自動車・自動車部品
EXOR NV		—	23	126	15,637	各種金融
AIRBUS SE		147	127	939	116,347	資本財
STMICROELECTRONICS NV		159	139	210	26,079	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		20	17	92	11,462	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER		75	66	256	31,810	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV		802	747	212	26,360	電気通信サービス
AKZO NOBEL		61	55	415	51,406	素材
HEINEKEN NV		57	50	430	53,341	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		238	207	684	84,752	資本財
RELX NV		249	218	397	49,233	商業・専門サービス
AEGON NV		456	388	178	22,079	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		208	280	554	68,638	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV		32	26	146	18,102	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		25	22	180	22,357	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		45	39	261	32,384	素材
ING GROEP NV		968	849	1,298	160,799	銀行
ASML HOLDING NV		86	81	1,003	124,266	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		407	356	1,762	218,135	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		17	15	66	8,203	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER		21	19	63	7,847	資本財
TNT EXPRESS NV		105	—	—	—	運輸
OCI NV		21	—	—	—	素材
NN GROUP NV		79	68	220	27,238	保険
ALTICE NV - B		26	22	50	6,302	メディア
ALTICE NV - A		93	82	185	22,905	メディア
ABN AMRO GROUP NV-CVA		—	64	157	19,439	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,960	4,470	10,663	1,320,176	
(ユーロ…スペイン)		28	28	—	<1.5%>	
BANCO POPULAR ESPANOL		431	708	55	6,910	銀行
ENDESA SA		80	70	146	18,100	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		47	41	142	17,642	資本財
IBERDROLA SA		1,380	1,211	811	100,516	公益事業
TELEFONICA SA		1,126	992	994	123,180	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		3,609	3,195	1,936	239,723	銀行
BANKINTER SA		167	146	123	15,311	銀行

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	金額	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
REPSOL SA	274	246	362	44,863	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,590	1,438	1,062	131,520	銀行
GAS NATURAL SDG SA	89	77	158	19,683	公益事業
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	272	237	852	105,563	小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	130	141	228	28,287	運輸
MAPFRE SA	261	232	76	9,440	保険
FERROVIAL SA	118	106	208	25,856	資本財
FERROVIAL SA-RTS	—	106	3	422	資本財
ZARDOYA OTIS SA	44	44	38	4,719	資本財
ENAGAS SA	55	50	127	15,772	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA	27	96	180	22,286	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	1,279	1,159	212	26,315	銀行
CAIXABANK S. A	663	785	333	41,321	銀行
GRIFOLS SA	74	65	163	20,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA	109	95	496	61,431	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	207	190	135	16,732	運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	146	141	76	9,462	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA	1,143	1,025	112	13,977	銀行
AENA SA	16	14	244	30,239	運輸
小計	株数・金額	13,348	12,623	9,285	1,149,576
銘柄数<比率>	25	26	—	<1.3%>	
(ユーロ…ベルギー)					
AGEAS	50	42	158	19,668	保険
UCB SA	31	27	212	26,334	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	201	—	—	—	食品・飲料・タバコ
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	20	17	154	19,094	各種金融
DELHAIZE GROUP	21	—	—	—	食品・生活必需品小売り
UMICORE	23	20	122	15,142	素材
COLRUYT SA	17	14	69	8,599	食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV	62	54	364	45,154	銀行
SOLVAY SA	18	16	197	24,462	素材
PROXIMUS	38	34	103	12,771	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	13	12	68	8,512	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	—	166	1,820	225,335	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	499	408	3,272	405,075
銘柄数<比率>	11	10	—	<0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	70	66	217	26,872	銀行
OMV AG	37	34	143	17,822	エネルギー
VOESTALPINE AG	28	25	99	12,330	素材
ANDRITZ AG	19	16	87	10,781	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	29	25	54	6,710	銀行
小計	株数・金額	185	167	601	74,517
銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
RTL GROUP	9	8	57	7,062	メディア
TENARIS SA	117	103	149	18,471	エネルギー
SES	81	80	163	20,279	メディア
EUROFINS SCIENTIFIC	—	2	115	14,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL	426	402	290	36,016	素材
小計	株数・金額	635	597	776	96,101
銘柄数<比率>	4	5	—	<0.1%>	

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ	1,444	1,278	715	88,614	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	137	120	137	16,990	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	28	25	97	12,039	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	133	116	287	35,597	素材
FORTUM OYJ	112	98	136	16,878	公益事業
KONE OYJ-B	84	73	314	38,893	資本財
METSO OYJ	28	24	77	9,633	資本財
SAMPO OYJ-A SHS	111	97	443	54,942	保険
WARTSILA OYJ ABP	36	32	175	21,766	資本財
ELISA OYJ	35	30	102	12,699	電気通信サービス
NESTE OYJ	32	28	105	13,086	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	25	22	126	15,687	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	2,210	1,948	2,720	336,829
	銘 柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.4%>
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	40	35	289	35,849	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC	20	20	196	24,292	消費者サービス
BANK OF IRELAND	7,084	6,176	152	18,887	銀行
CRH PLC	209	184	631	78,192	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	7,355	6,416	1,269	157,221
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	586	539	176	21,809	公益事業
JERONIMO MARTINS	62	56	94	11,668	食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	10,346	—	—	—	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA	116	110	157	19,455	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	11,112	705	427	52,932
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	3	—	<0.1%>
(ユーロ…イギリス)					
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	48	176	21,829	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	—	48	176	21,829
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.0%>
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	67,551	50,827	86,063	10,654,701
	銘 柄 数 < 比 率 >	229	234	—	<12.4%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	4,201	3,705	765	112,346	銀行
BP PLC	4,586	4,152	1,893	277,860	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,294	14,067	979	143,830	銀行
ASTRAZENECA PLC	316	276	1,314	192,864	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	98	86	142	20,968	資本財
NEXT PLC	36	30	131	19,371	小売
DIAGEO PLC	629	551	1,266	185,839	食品・飲料・タバコ
SKY PLC	259	227	226	33,259	メディア
BAE SYSTEMS PLC	791	694	444	65,309	資本財
UNILEVER PLC	320	280	1,147	168,381	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	2,039	1,793	323	47,464	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	278	238	383	56,241	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	408	355	134	19,675	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	159	138	1,009	148,122	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	643	564	994	145,986	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,488	1,304	332	48,758	保険
SAGE GROUP PLC/THE	270	236	162	23,834	ソフトウェア・サービス

銘柄	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	
HSBC HOLDINGS PLC		4,899	4,339	2,942	431,801	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		466	408	2,180	319,985	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		175	154	157	23,134	公益事業
SCHRODERS PLC		31	29	96	14,145	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		869	773	201	29,612	銀行
BHP BILLITON PLC		528	462	542	79,618	素材
IMPERIAL BRANDS PLC		240	209	774	113,644	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		323	281	479	70,320	メディア
CENTRICA PLC		1,276	1,206	231	34,032	公益事業
BT GROUP PLC		2,118	1,862	554	81,430	電気通信サービス
SSE PLC		254	226	328	48,156	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		819	719	541	79,441	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		460	402	350	51,486	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C		32,679	28,578	2	419	資本財
COMPASS GROUP PLC		411	359	573	84,100	消費者サービス
KINGFISHER PLC		572	490	169	24,843	小売
PEARSON PLC		205	180	127	18,733	メディア
SEVERN TRENT PLC		61	53	130	19,151	公益事業
RIO TINTO PLC		310	272	813	119,387	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,218	1,067	1,737	255,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC		244	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC		36	32	105	15,545	各種金融
3I GROUP PLC		241	210	174	25,672	各種金融
GKN PLC		428	375	131	19,373	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC		6,644	5,823	1,201	176,297	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS		555	486	117	17,287	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC		336	357	94	13,917	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC		1,011	888	477	70,103	保険
CAPITA PLC		166	144	80	11,882	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC		244	210	68	10,058	小売
JOHNSON MATTHEY PLC		48	42	132	19,445	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC		254	223	137	20,164	保険
WHITBREAD PLC		45	40	164	24,077	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		941	829	856	125,638	公益事業
ARM HOLDINGS PLC		351	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC		63	55	275	40,426	資本財
BUNZL PLC		84	73	179	26,382	資本財
COBHAM PLC		286	375	50	7,380	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		350	306	322	47,372	素材
INTERTEK GROUP PLC		40	35	148	21,775	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC		220	191	56	8,279	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC		111	97	159	23,466	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		49	39	168	24,659	消費者サービス
CARNIVAL PLC		47	41	198	29,154	消費者サービス
PERSIMMON PLC		76	67	161	23,752	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC		193	168	80	11,883	資本財
ICAP PLC		138	—	—	—	各種金融
ITV PLC		957	794	150	22,034	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		78	69	236	34,761	各種金融
G4S PLC		390	337	106	15,662	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		32	28	94	13,832	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		250	218	132	19,377	耐久消費財・アパレル

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期		業 種 等
				株数	評 価 額	
					外貨建金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
IMI PLC		68	59	77	11,325	資本財
REXAM PLC		147	—	—	—	素材
SMITH & NEPHEW PLC		224	191	250	36,727	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC		116	104	79	11,725	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC		813	713	141	20,787	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		986	956	2,040	299,472	エネルギー
PETROFAC LTD		64	57	46	6,845	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC		62	54	87	12,851	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		992	822	1,806	265,086	エネルギー
OLD MUTUAL PLC		1,233	1,080	211	31,008	保険
INVESTEC PLC		139	142	83	12,251	各種金融
STANDARD LIFE PLC		493	433	166	24,487	保険
EXPERIAN PLC		242	209	350	51,439	商業・専門サービス
MONDI PLC		91	80	160	23,559	素材
WEIR GROUP PLC/THE		53	48	91	13,423	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		89	78	224	32,936	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC		98	86	67	9,853	素材
SHIRE PLC		148	198	927	136,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC		112	97	73	10,770	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC		52	45	93	13,756	保険
FRESNILLO PLC		55	49	74	10,976	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD		23	20	146	21,512	素材
AGGREKO PLC		64	—	—	—	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC		63	55	49	7,309	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC		131	115	135	19,842	保険
GLENCORE PLC		3,062	2,676	776	113,959	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC		230	201	58	8,633	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC		65	56	80	11,812	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC		32	28	111	16,432	素材
COCA-COLA HBC AG-DI		50	38	84	12,445	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC		41	35	46	6,765	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		343	300	106	15,593	保険
ROYAL MAIL PLC		225	196	83	12,190	運輸
ASHTED GROUP PLC		126	109	178	26,142	資本財
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL		67	—	—	—	小売
MERLIN ENTERTAINMENT		177	151	75	11,148	消費者サービス
TUI AG-DI		124	109	128	18,887	消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		—	32	57	8,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		92	78	65	9,610	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		239	216	88	12,987	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY GROUP PLC		349	400	125	18,446	ソフトウェア・サービス
DCC PLC		—	20	148	21,736	資本財
小	計	株数・金額	105,469	93,700	40,455	5,937,643
	銘柄数<比率>		109	105	—	<6.9%>
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		798	682	5,509	622,903	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		130	114	981	110,996	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		449	435	650	73,591	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		113	100	562	63,602	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		175	154	4,121	466,030	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG		2	2	393	44,488	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		13	11	169	19,206	ヘルスケア機器・サービス

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	37	32	922	104,309	保険
SYNGENTA AG-REG	23	20	951	107,589	素材
LONZA GROUP AG-REG	13	12	252	28,532	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	12	11	88	10,002	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	8	184	20,822	資本財
GEBERIT AG-REG	9	8	370	41,923	資本財
SWISS RE AG	87	70	629	71,180	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	6	275	31,112	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	7	7	54	6,207	各種金融
NOVARTIS AG-REG	569	489	3,867	437,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	41	35	274	31,079	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	6	5	256	28,943	電気通信サービス
ABB LTD-REG	550	412	1,018	115,137	資本財
SGS SA-REG	1	1	277	31,368	商業・専門サービス
SULZER AG-REG	3	—	—	—	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	4	90	10,200	資本財
ACTELION LTD-REG	25	21	598	67,631	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	13	11	178	20,194	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	12	11	162	18,373	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	7	227	25,757	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.02	139	15,779	食品・飲料・タバコ
ARYZTA AG	21	19	67	7,615	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	56	49	260	29,421	各種金融
SIKA AG-BR	0.54	0.47	296	33,477	素材
SWISS PRIME SITE-REG	16	15	140	15,843	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.25	0.22	127	14,438	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4	3	234	26,481	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	0.49	69	7,811	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	1	119	13,521	素材
UBS GROUP AG-REG	915	801	1,348	152,475	各種金融
DUFREY AG-REG	10	10	166	18,842	小売
GALENICA AG-REG	0.98	0.85	97	11,051	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	4,161	3,582	26,138	2,955,182
銘 柄 数 < 比 率 >		39	38	—	<3.5%>
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	60	52	1,441	18,492	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	761	672	3,868	49,632	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	97	85	2,533	32,509	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	380	333	3,536	45,372	銀行
INVESTOR AB-B SHS	113	99	4,083	52,391	各種金融
NORDEA BANK AB	759	665	7,479	95,964	銀行
GETINGE AB-B SHS	50	44	795	10,206	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	375	334	4,228	54,252	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	168	149	4,962	63,671	資本財
SKF AB-B SHARES	99	87	1,615	20,731	資本財
ASSA ABLOY AB-B	250	219	4,247	54,494	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	237	207	4,432	56,872	小売
SANDVIK AB	267	233	3,268	41,938	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	226	198	4,287	55,007	銀行
SECURITAS AB-B SHS	78	68	944	12,115	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B	151	132	3,933	50,463	家庭用品・パーソナル用品
SKANSKA AB-B SHS	94	74	1,605	20,595	資本財

銘柄		株数	株数	当 期 末		業 種 等
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
SWEDISH MATCH AB		49	41	1,227	15,745	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		79	79	695	8,926	電気通信サービス
TELIA CO AB		647	565	2,139	27,444	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS		385	342	4,982	63,924	資本財
ALFA LAVAL AB		73	63	1,145	14,698	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB		54	40	695	8,917	エネルギー
BOLIDEN AB		68	59	1,449	18,596	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		104	91	824	10,583	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		16	14	692	8,885	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS		64	56	2,215	28,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B		58	51	1,252	16,070	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		40	35	755	9,691	各種金融
ICA GRUPPEN AB		20	17	533	6,846	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS		—	8	542	6,958	各種金融
小 計		株 数 ・ 金 額	5,836	5,127	76,416	980,428
		銘柄 数 < 比 率 >	30	31	—	<1.1%>
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		245	214	3,149	41,733	銀行
NORSK HYDRO ASA		335	291	1,372	18,188	素材
ORKLA ASA		203	178	1,445	19,152	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA		279	251	3,841	50,902	エネルギー
TELENOR ASA		187	164	2,197	29,122	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		44	38	1,246	16,511	素材
MARINE HARVEST		—	84	1,234	16,361	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		50	43	594	7,879	保険
SCHIBSTED ASA-CL A		18	18	404	5,353	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS		22	18	371	4,928	メディア
小 計		株 数 ・ 金 額	1,388	1,303	15,859	210,132
		銘柄 数 < 比 率 >	9	10	—	<0.2%>
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		490	418	11,512	191,573	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		58	50	1,498	24,933	素材
DANSKE BANK A/S		177	151	3,856	64,178	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING		6	26	440	7,332	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		56	48	2,990	49,754	資本財
TDC A/S		203	174	646	10,756	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B		26	23	1,662	27,658	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		27	26	1,436	23,907	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S		48	41	1,621	26,981	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		1	1	1,778	29,590	運輸
TRYG A/S		29	24	331	5,513	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.96	0.79	922	15,354	運輸
PANDORA A/S		27	24	1,668	27,769	耐久消費財・アパレル
ISS A/S		37	36	1,042	17,341	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		24	21	1,010	16,816	素材
GENMAB A/S		13	13	1,764	29,354	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG ENERGY A/S		—	34	956	15,909	公益事業
小 計		株 数 ・ 金 額	1,230	1,118	35,139	584,724
		銘柄 数 < 比 率 >	16	17	—	<0.7%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP BILLITON LIMITED		805	704	1,663	139,867	素材
CSL LTD		116	100	1,363	114,654	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		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
ALUMINA LTD	659	545	96	8,115	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	186	167	547	46,006	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	730	643	1,886	158,611	銀行	
RIO TINTO LTD	106	93	557	46,864	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	347	303	412	34,697	保険	
LENLEASE GROUP	141	123	206	17,322	不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	428	379	3,110	261,592	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	834	735	2,399	201,781	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	660	584	1,888	158,810	銀行	
BRAMBLES LTD	400	354	373	31,381	商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	147	113	54	4,599	運輸	
BORAL LTD	193	261	179	15,056	素材	
WOOLWORTHS LTD	319	285	774	65,112	食品・生活必需品小売り	
TELSTRA CORP LTD	1,082	929	408	34,373	電気通信サービス	
AMP LTD	754	658	349	29,368	各種金融	
TABCORP HOLDINGS LTD	217	190	90	7,601	消費者サービス	
AMCOR LIMITED	293	257	396	33,374	素材	
COMPUTERSHARE LTD	121	107	163	13,726	ソフトウェア・サービス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	140	121	249	20,974	消費者サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	77	67	635	53,435	各種金融	
CIMIC GROUP LTD	26	21	88	7,401	資本財	
ASX LTD	50	43	227	19,150	各種金融	
COCA-COLA AMATIL LTD	149	127	123	10,415	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD	14	12	190	16,007	ヘルスケア機器・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	100	219	18,466	素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	146	124	50	4,277	小売	
NEWCREST MINING LTD	192	169	341	28,715	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	621	530	344	28,933	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	442	389	308	25,935	エネルギー	
ORICA LTD	94	83	158	13,342	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	100	89	210	17,676	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD	422	405	148	12,473	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	327	288	420	35,363	保険	
TRANSURBAN GROUP	518	458	561	47,216	運輸	
WESFARMERS LTD	283	248	1,094	92,074	食品・生活必需品小売り	
CHALLENGER LTD	147	128	170	14,370	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	286	252	184	15,477	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	69	58	192	16,187	エネルギー	
OIL SEARCH LTD	345	305	222	18,727	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	176	152	412	34,657	公益事業	
TATTS GROUP LTD	380	317	139	11,706	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	393	342	166	14,021	素材	
ASCIANO LTD	129	—	—	—	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	107	—	—	—	素材	
AUSNET SERVICES	514	485	84	7,121	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	93	81	104	8,754	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	431	386	143	12,071	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	106	131	11,054	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	535	459	254	21,401	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	187	164	217	18,294	食品・飲料・タバコ	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	36	32	236	19,922	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	11	40	3,401	消費者サービス	

銘柄	株数	当期		業種等
		株数	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
SEEK LTD	84	72	133	11,214
BANK OF QUEENSLAND LTD	97	91	109	9,203
REA GROUP LTD	14	11	76	6,426
TPG TELECOM LTD	76	76	45	3,864
HEALTHSCOPE LTD	449	397	90	7,621
MEDIBANK PRIVATE LTD	701	616	185	15,594
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	66	—	—	—
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	15	100	8,425
SOUTH32 LTD	1,342	1,169	309	26,056
VOCUS GROUP LTD	116	114	28	2,406
小計	株数・金額	19,187	16,672	26,076
	銘柄数<比率>	63	61	—
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル	
SPARK NEW ZEALAND LTD	380	397	148	11,529
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	202	209	143	11,157
CONTACT ENERGY LTD	155	165	86	6,758
FLETCHER BUILDING LTD	144	151	129	10,090
RYMAN HEALTHCARE LTD	79	82	69	5,434
MERIDIAN ENERGY LTD	283	290	81	6,350
MERCURY NZ LTD	156	153	49	3,831
小計	株数・金額	1,402	1,449	708
	銘柄数<比率>	7	7	—
(香港)			千香港ドル	
WHARF HOLDINGS LTD	330	300	2,010	29,406
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	145	120	892	13,052
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	683	593	6,045	88,451
SUN HUNG KAI PROPERTIES	440	320	3,731	54,587
MTR CORP	365	320	1,489	21,792
HONG KONG & CHINA GAS	1,767	1,733	2,721	39,822
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,370	1,250	1,226	17,940
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	340	310	2,213	32,382
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	280	255	4,990	73,008
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	320	260	284	4,168
HANG LUNG GROUP LTD	—	190	615	9,006
HANG LUNG PROPERTIES LTD	550	490	960	14,050
CLP HOLDINGS LTD	485	360	2,995	43,819
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	276	242	1,202	17,590
BANK OF EAST ASIA LTD	294	262	858	12,553
HANG SENG BANK LTD	194	163	2,653	38,822
HYSAN DEVELOPMENT CO	160	140	515	7,547
SHANGRI-LA ASIA LTD	320	260	290	4,252
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	50	60	724	10,603
SINO LAND CO	750	690	931	13,627
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	200	165	544	7,966
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	180	150	1,036	15,163
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	940	815	2,665	38,989
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	335	305	1,062	15,550
PCCW LTD	1,050	1,010	462	6,767
LI & FUNG LTD	1,480	1,300	421	6,162
KERRY PROPERTIES LTD	175	155	447	6,553
NWS HOLDINGS LTD	360	350	532	7,793
SANDS CHINA LTD	588	532	1,840	26,929

銘柄	株数	株数	期末		業 種 等
			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	
WHEELLOCK & CO LTD	230	180	1,098	16,076	不動産
WYNN MACAU LTD	396	336	535	7,835	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	510	470	336	4,916	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	620	440	257	3,765	各種金融
AIA GROUP LTD	3,002	2,642	14,755	215,873	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	288	248	637	9,324	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	570	520	2,106	30,810	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	240	200	333	4,880	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	680	820	821	12,020	電気通信サービス
WH GROUP LTD	1,480	1,785	1,212	17,731	食品・飲料・タバコ
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	678	588	3,365	49,232	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	株 数	71,827	1,050,834	
	銘柄 数 < 比 率 >	40	—	< 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	780	694	732	59,296	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	414	372	125	10,173	メディア
SEBACORP INDUSTRIES LTD	249	238	75	6,085	資本財
CAPITALAND LTD	648	577	210	17,040	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	110	89	96	7,813	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	26	21	98	7,968	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	440	390	816	66,044	銀行
KEPPEL CORP LTD	363	323	213	17,300	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	329	291	697	56,436	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	398	342	129	10,515	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,998	1,791	664	53,761	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	143	125	134	10,912	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	208	177	130	10,568	各種金融
SEBACORP MARINE LTD	214	—	—	—	資本財
UOL GROUP LTD	127	107	75	6,146	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	547	472	128	10,387	運輸
NOBLE GROUP LTD	1,188	—	—	—	資本財
STARHUB LTD	162	127	34	2,805	電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,801	1,525	56	4,567	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	492	442	151	12,266	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE PLC	1,539	1,381	149	12,067	消費者サービス
SATS LTD	—	160	84	6,861	運輸
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	796	586	170	13,797	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	487	378	47	3,807	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	株 数	5,025	406,623	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	—	< 0.5% >	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD	127	107	162	5,141	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	228	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK HAPOLIM BM	263	234	534	16,894	銀行
NICE LTD	14	13	366	11,562	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	348	317	535	16,903	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	—	5	215	6,802	資本財
DELEK GROUP LTD	1	—	—	—	エネルギー
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	481	438	272	8,615	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	34	28	174	5,495	銀行
AZRIELI GROUP LTD	9	8	178	5,627	不動産

銘柄		株数	当 期 末		業 種 等	
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル) FRUTAROM		百株	百株	千イスラエルシェケル	千円	素材
小計	株数・金額	1,508	1,163	191	6,059	
	銘柄数<比率>	9	9	—	83,102	
合計	株数・金額	332,807	284,397	—	<0.1%>	
	銘柄数<比率>	1,259	1,261	—	80,733,104	
					<94.3%>	

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

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

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	11	10	317	36,122	0.0	
MACERICH CO/THE	3	2	159	18,168	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	1	207	23,599	0.0	
PROLOGIS INC	13	11	629	71,743	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	1	156	17,779	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	3	120	13,723	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	3	396	45,149	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	359	41,007	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	2	199	22,761	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	202	23,072	0.0	
WELLTOWER INC	8	7	567	64,684	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3	3	408	46,525	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	2	246	28,140	0.0	
REALTY INCOME CORP	6	5	307	34,996	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	2	3	208	23,749	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	2	2	234	26,667	0.0	
UDR INC	6	5	220	25,111	0.0	
VENTAS INC	8	7	506	57,703	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23	22	251	28,622	0.0	
WEYERHAEUSER CO	19	16	540	61,551	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	10	9	1,177	134,200	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	8	7	141	16,147	0.0	
VEREIT INC	22	21	159	18,200	0.0	
DUKE REALTY CORP	8	7	221	25,273	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4	6	126	14,364	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	5	5	191	21,845	0.0	
EQUINIX INC	1	1	675	76,945	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	8	7	745	84,893	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	9	7	517	58,994	0.1	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	11	150	17,168	0.0	
GGP INC	14	12	283	32,275	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	18	16	287	32,738	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	3	130	14,851	0.0	
PUBLIC STORAGE	3	3	671	76,532	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	6	1,114	126,931	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	4	3	350	39,917	0.0	
KIMCO REALTY CORP	10	9	176	20,160	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	3	575	65,611	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	269	262	13,936	1,587,934	
	銘 柄 数 < 比 率 >	35	38	—	<1.9%>	
(カナダ)			千カナダドル			
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1	1	40	3,377	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	2	65	5,479	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	89	7,460	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	8	7	196	16,316	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		0.862	0.888	120	14,885	0.0
KLEPIERRE		5	4	180	22,310	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	2	512	63,496	0.1
FONCIERE DES REGIONS		0.753	0.804	68	8,487	0.0
ICADE		0.829	0.812	58	7,238	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	10	9	940	116,418	
	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		20	21	142	20,977	0.0
HAMMERSON PLC		19	17	102	15,018	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		19	17	195	28,638	0.0
INTU PROPERTIES PLC		23	20	58	8,570	0.0
SEGRO PLC		18	18	91	13,458	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	102	95	590	86,662	
	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		86	75	214	18,042	0.0
SCENTRE GROUP		135	118	506	42,571	0.0
GPT GROUP		46	40	215	18,115	0.0
MIRVAC GROUP		95	83	190	16,038	0.0
STOCKLAND		61	54	259	21,819	0.0
WESTFIELD CORP		50	43	392	32,999	0.0
DEXUS		25	21	223	18,821	0.0
GOODMAN GROUP		45	40	330	27,814	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	545	477	2,333	196,222	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		57	49	2,810	41,112	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	57	49	2,810	41,112	
	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	52	92	7,490	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		53	45	73	5,934	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		63	56	109	8,880	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		54	54	142	11,530	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	233	208	418	33,835	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,227	1,110	—	2,078,502	
	銘 柄 数 < 比 率 >	61	64	—	<2.4%>	

(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) 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		期末	
			買建額		売建額	
外国	株式先物取引	SP EMINI	百万円		百万円	
		SP/TSE60	2,697		—	
		SWISS IX	152		—	
		EURO ST	153		—	
		SPI 200	639		—	
		FTSE100	209		—	
			302		—	

(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

(2017年5月12日現在)

項目	当	期	末
	評	価	率
		千円	%
株式		80,733,104	91.2
投資証券		2,078,502	2.3
コール・ローン等、その他		5,677,256	6.5
投資信託財産総額		88,488,862	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (87,416,700千円) の投資信託財産総額 (88,488,862千円) に対する比率は98.8%です。

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

1 アメリカドル=113.94円	1 カナダドル=83.13円	1 ユーロ=123.80円	1 イギリスポンド=146.77円
1 スイスフラン=113.06円	1 スウェーデンクローネ=12.83円	1 ノルウェークローネ=13.25円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=84.09円	1 ニュージーランドドル=77.83円	1 香港ドル=14.63円	1 シンガポールドル=80.91円
1 イスラエルシェケル=31.58円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	173,489,779,062
コール・ローン等	2,271,589,995
株式(評価額)	80,733,104,146
投資証券(評価額)	2,078,502,529
未収入金	85,106,469,129
未収配当金	154,819,239
差入委託証拠金	3,145,294,024
(B) 負債	87,840,823,861
未払金	86,732,078,933
未払解約金	1,108,743,397
未払利息	1,531
(C) 純資産総額(A－B)	85,648,955,201
元本	54,368,337,558
次期繰越損益金	31,280,617,643
(D) 受益権総口数	54,368,337,558口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,753円

<注記事項>

- ①期首元本額 65,607,671,368円
期中追加設定元本額 13,010,185,812円
期中一部解約元本額 24,249,519,622円
また、1口当たり純資産額は、期末1.5753円です。

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

国内株式セレクション（ラップ向け）	790,805円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	1,857,428,655円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	19,536,871,489円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	11,008,256,227円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,735,164,782円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,085,523,040円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	3,449,798,649円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	15,976,708円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	93,386,663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）	14,585,140,540円
合計	54,368,337,558円

〔お 知 ら せ 〕

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年7月1日)

○損益の状況 (2016年5月13日～2017年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,929,991,032
受取配当金	1,913,089,374
受取利息	△ 645,935
その他収益金	25,868,291
支払利息	△ 8,320,698
(B) 有価証券売買損益	11,603,358,464
売買益	31,687,490,837
売買損	△20,084,132,373
(C) 先物取引等取引損益	1,571,451,771
取引益	1,813,024,981
取引損	△ 241,573,210
(D) 保管費用等	△ 29,706,307
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	15,075,094,960
(F) 前期繰越損益金	21,534,062,535
(G) 追加信託差損益金	6,138,729,831
(H) 解約差損益金	△11,467,269,683
(I) 計(E+F+G+H)	31,280,617,643
次期繰越損益金(I)	31,280,617,643

(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。