

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類   | 追加型投信／海外／株式／インデックス型  |   |
|--------|--|---|
| 信託期間   | 無期限（2001年12月5日設定）  |   |
| 運用方針   | マザーファンドを通じて、日本を除く世界の主要国の株式に投資することにより、MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) と連動する投資成果をめざします。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。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |   |
| 主要運用対象 | ベビーフンド   | 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、日本を除く世界の各国の株式に直接投資することがあります。      |
|        | マザーファンド  | MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) 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。<br>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。<br>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。  |   |
|        | <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;">           分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)         </div>               |   |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

## 運用報告書（全体版）

# 三菱UFJ <DC> 外国株式インデックス ファンド

第17期（決算日：2018年5月14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「三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド」は、去る5月14日に第17期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。  
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |        |        | MSCI Kokusai Index<br>(MSCIコクサイインデックス) |        | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券組入比率 | 純資産<br>総額 |        |        |
|-----------------|--------|--------|--------|--|--------|------------|------------|----------------|-----------|--------|--------|
|                 | (分配落)  | 税<br>分 | 込<br>配 | み<br>金                                 | 期<br>騰 |            |            |                |           | 中<br>落 | 率      |
|                 | 円      | 円      | 円      | 円                                      | 円      | %          | %          | %              | 百万円       |        |        |
| 13期(2014年5月12日) | 16,375 |        | 0      |  | 16.1   | 130.71     | 14.3       | 96.7           | 1.1       | 2.1    | 6,320  |
| 14期(2015年5月12日) | 20,604 |        | 0      |  | 25.8   | 162.29     | 24.2       | 96.4           | 1.2       | 2.2    | 9,007  |
| 15期(2016年5月12日) | 17,475 |        | 0      |  | △15.2  | 135.59     | △16.4      | 94.4           | 2.8       | 2.7    | 8,082  |
| 16期(2017年5月12日) | 21,347 |        | 0      |  | 22.2   | 163.31     | 20.4       | 92.8           | 1.9       | 2.4    | 10,206 |
| 17期(2018年5月14日) | 23,329 |        | 0      |  | 9.3    | 176.07     | 7.8        | 94.4           | 3.4       | 2.2    | 11,805 |

- (注) MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index (米ドルベース)をもとに委託会社が計算したものです。また、MSCI Kokusai Indexに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- (注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
- (注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○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<br>(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   | 騰 落 率 | (円換算ベース)  | 騰 落 率 |           |           |                     |
| (期 首)<br>2017年5月12日 | 円       | %     |   | %     | %         | %         | %                   |
|                     | 21,347  | —     | 163.31  | —     | 92.8      | 1.9       | 2.4                 |
| 5月末                 | 21,016  | △ 1.6 | 160.55  | △ 1.7 | 94.5      | 3.2       | 2.4                 |
| 6月末                 | 21,330  | △ 0.1 | 162.71  | △ 0.4 | 94.4      | 3.3       | 2.5                 |
| 7月末                 | 21,476  | 0.6   | 163.87  | 0.3   | 94.7      | 2.9       | 2.5                 |
| 8月末                 | 21,380  | 0.2   | 162.88  | △ 0.3 | 91.8      | 6.1       | 2.4                 |
| 9月末                 | 22,360  | 4.7   | 170.16  | 4.2   | 93.4      | 4.5       | 2.4                 |
| 10月末                | 22,861  | 7.1   | 173.90  | 6.5   | 94.7      | 4.4       | 2.4                 |
| 11月末                | 23,002  | 7.8   | 174.81  | 7.0   | 94.0      | 3.4       | 2.4                 |
| 12月末                | 23,699  | 11.0  | 179.96  | 10.2  | 94.0      | 3.7       | 2.4                 |
| 2018年1月末            | 23,949  | 12.2  | 181.88  | 11.4  | 96.5      | 1.4       | 2.2                 |
| 2月末                 | 22,856  | 7.1   | 173.38  | 6.2   | 93.2      | 5.0       | 2.1                 |
| 3月末                 | 21,872  | 2.5   | 165.65  | 1.4   | 92.9      | 5.1       | 2.2                 |
| 4月末                 | 22,839  | 7.0   | 172.74  | 5.8   | 95.0      | 2.8       | 2.2                 |
| (期 末)<br>2018年5月14日 | 円       | %     |   | %     | %         | %         | %                   |
|                     | 23,329  | 9.3   | 176.07  | 7.8   | 94.4      | 3.4       | 2.2                 |

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

## 当期中の基準価額等の推移について

(第17期：2017/5/13～2018/5/14)

|            |  |
|------------|--|
| 基準価額の動き    | 基準価額は期首に比べ9.3%の上昇となりました。               |
| ベンチマークとの差異 | ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（7.8%）を1.5%上回りました。 |



- ・分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。



実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

## 基準価額の変動要因

## 上昇要因

- ・米国の堅調な企業決算内容や税制改革などが好感され外国株式市況が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

## 投資環境について

(第17期：2017/5/13～2018/5/14)

## ◎外国株式市況

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

## ◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて4.1%の円高・米ドル安、5.6%の円安・ユーロ高となりました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

**i** 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

## &lt;三菱UFJ &lt;DC&gt;外国株式インデックスファンド&gt;

- ・主として、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・不動産投資信託証券（REIT）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。

## &lt;外国株式インデックスマザーファンド&gt;

基準価額は期首に比べ10.2%の上昇となりました。

- ・MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）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

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

**i** ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

### <三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド>

ベンチマークとの乖離は1.5%程度となりました。

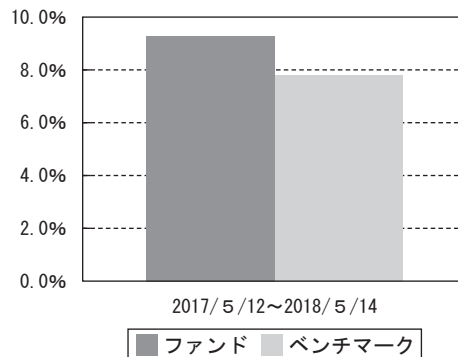
|                | マザーファンド<br>保有以外の要因 | マザーファンド<br>保有による要因 | 合 計    |
|----------------|--------------------|--------------------|--------|
| ベンチマーク<br>との乖離 | △0.9%程度            | 2.4%程度             | 1.5%程度 |

(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△0.9%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2.4%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）



### <外国株式インデックスマザーファンド>

ベンチマークは7.8%の上昇となったため、乖離は2.4%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    |
|------------|--------|---------|--------|--------|
| ベンチマークとの乖離 | 0.0%程度 | △0.0%程度 | 2.4%程度 | 2.4%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 $\Delta 0.0\%$ 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 $2.4\%$ 程度でした。

- ・その他の要因としては、配当・利子収入、為替効果、売買コスト、保管料等による影響などが含まれます。

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。

ファンド：株価（現地通貨建て前日終値）を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートをを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

## 分配金について

**i** 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

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17期                  |
|-----------|-----------------------|
|           | 2017年5月13日～2018年5月14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 | 17,897                |

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## 今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

### <三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド>

- ・ファンド資産のほぼ全額を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。

### <外国株式インデックスマザーファンド>

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・REITを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。



## ○ 1万口当たりの費用明細

(2017年5月13日～2018年5月14日)

| 項 目                   | 当 期    |           | 項 目 の 概 要   |
|-----------------------|--------|-----------|---|
|                       | 金 額    | 比 率       |   |
| (a) 信 託 報 酬           | 192    | 0.856     | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×<br>(期中の日数÷年間日数)                         |
| （ 投 信 会 社 ）           | ( 87 ) | ( 0.390 ) | 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 ）           | ( 85 ) | ( 0.379 ) | 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 ）           | ( 19 ) | ( 0.087 ) | 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     | 2      | 0.009     | (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<br>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 )  | ( 0.005 ) |   |
| （ 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     | 6      | 0.025     | (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<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金       |
| （ 株 式 ）               | ( 5 )  | ( 0.025 ) |   |
| （ 投 資 信 託 証 券 ）       | ( 0 )  | ( 0.000 ) |   |
| (d) そ の 他 費 用         | 7      | 0.033     | (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 )  | ( 0.030 ) | 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 ）           | ( 1 )  | ( 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 )  | ( 0.000 ) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用  |
| 合 計                   | 207    | 0.923     |   |
| 期中の平均基準価額は、22,386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

(2017年5月13日～2018年5月14日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄                | 設定            |                 | 解約            |               |
|-------------------|---------------|-----------------|---------------|---------------|
|                   | 口数            | 金額              | 口数            | 金額            |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 千口<br>452,706 | 千円<br>1,165,303 | 千口<br>245,881 | 千円<br>626,806 |

## ○株式売買比率

(2017年5月13日～2018年5月14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                |  |
|---------------------|-------------------|--|
|                     | 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       | 316,730,772千円     |  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 339,953,187千円     |  |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.93              |  |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年5月13日～2018年5月14日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;三菱UFJ &lt;DC&gt;外国株式インデックスファンド&gt;

該当事項はございません。

&lt;外国株式インデックスマザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等 A          |              |          | 売付額等 C          |              |          |
|--------|-----------------|--------------|----------|-----------------|--------------|----------|
|        | うち利害関係人との取引状況 B | B/A          | %        | うち利害関係人との取引状況 D | D/C          | %        |
| 為替直物取引 | 百万円<br>208,023  | 百万円<br>3,608 | %<br>1.7 | 百万円<br>226,799  | 百万円<br>8,888 | %<br>3.9 |

平均保有割合 3.1%

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

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

## ○組入資産の明細

(2018年5月14日現在)

## 親投資信託残高

| 銘柄                | 期首(前期末)         | 当 期 末           |                  |
|-------------------|-----------------|-----------------|------------------|
|                   | 口 数             | 口 数             | 評 価 額            |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 千口<br>4,198,780 | 千口<br>4,405,605 | 千円<br>11,800,414 |

## ○投資信託財産の構成

(2018年5月14日現在)

| 項 目               | 当 期 末            |           |
|-------------------|------------------|-----------|
|                   | 評 価 額            | 比 率       |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 千円<br>11,800,414 | %<br>99.4 |
| コール・ローン等、その他      | 67,367           | 0.6       |
| 投資信託財産総額          | 11,867,781       | 100.0     |

(注) 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(336,857,637千円)の投資信託財産総額(339,851,886千円)に対する比率は99.1%です。

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

|                    |                     |                    |                    |
|--------------------|---------------------|--------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=109.31円   | 1 カナダドル=85.55円      | 1 ユーロ=130.71円      | 1 イギリスポンド=148.27円  |
| 1 スイスフラン=109.44円   | 1 スウェーデンクローネ=12.72円 | 1 ノルウェークローネ=13.66円 | 1 デンマーククローネ=17.54円 |
| 1 オーストラリアドル=82.66円 | 1 ニュージーランドドル=76.25円 | 1 香港ドル=13.93円      | 1 シンガポールドル=82.00円  |
| 1 イスラエルシェケル=30.56円 |                     |                    |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月14日現在)

| 項 目                    | 当 期 末          |
|------------------------|----------------|
|                        | 円              |
| (A) 資産                 | 11,867,781,723 |
| コール・ローン等               | 67,367,534     |
| 外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 11,800,414,189 |
| (B) 負債                 | 62,390,022     |
| 未払解約金                  | 13,268,756     |
| 未払信託報酬                 | 48,929,237     |
| 未払利息                   | 87             |
| その他未払費用                | 191,942        |
| (C) 純資産総額(A-B)         | 11,805,391,701 |
| 元本                     | 5,060,425,287  |
| 次期繰越損益金                | 6,744,966,414  |
| (D) 受益権総口数             | 5,060,425,287口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)        | 23,329円        |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 4,781,056,549円  
 期中追加設定元本額 1,147,744,245円  
 期中一部解約元本額 868,375,507円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2,3329円です。

## ②分配金の計算過程

| 項 目                       | 2017年5月13日～<br>2018年5月14日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 211,550,559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 | 668,387,761円              |
| 収益調整金額                    | 5,936,766,838円            |
| 分配準備積立金額                  | 2,240,329,055円            |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 9,057,034,213円            |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 17,897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 (2017年5月13日～2018年5月14日)

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
|                  | 円                |
| (A) 配当等収益        | △ 23,178         |
| 受取利息             | 297              |
| 支払利息             | △ 23,475         |
| (B) 有価証券売買損益     | 974,382,842      |
| 売買益              | 1,068,905,498    |
| 売買損              | △ 94,522,656     |
| (C) 信託報酬等        | △ 94,421,344     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 879,938,320      |
| (E) 前期繰越損益金      | 2,240,329,055    |
| (F) 追加信託差損益金     | 3,624,699,039    |
| (配当等相当額)         | ( 5,934,365,158) |
| (売買損益相当額)        | (△2,309,666,119) |
| (G) 計(D+E+F)     | 6,744,966,414    |
| (H) 収益分配金        | 0                |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 6,744,966,414    |
| 追加信託差損益金         | 3,624,699,039    |
| (配当等相当額)         | ( 5,936,766,838) |
| (売買損益相当額)        | (△2,312,067,799) |
| 分配準備積立金          | 3,120,267,375    |

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

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。  
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)  
(2018年1月1日)
- ②よりわかりやすい記載を目的として目論見書の特色の分配方針に「分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)」を掲載しました。

## 外国株式インデックスマザーファンド

### 《第17期》決算日2018年5月14日

[計算期間：2017年5月13日～2018年5月14日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月14日に第17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17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) (円換算ベース) 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 (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) 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、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主 要 運 用 対 象 | MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) 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<br>(MSCIコクサイインデックス) |          | 株 式<br>組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 券 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|-----------|-----------|--|----------|----------------|-----------|------------------------|---------|
|                 | 期 騰 落 中 率 | 期 騰 落 中 率 | (円換算ベース)                               | (米ドルベース) |                |           |                        |         |
|                 | 円         | %         |  | %        | %              | %         | %                      | 百万円     |
| 13期(2014年5月12日) | 18,176    | 17.0      | 130.71                                 | 14.3     | 96.7           | 1.1       | 2.1                    | 197,280 |
| 14期(2015年5月12日) | 23,063    | 26.9      | 162.29                                 | 24.2     | 96.5           | 1.2       | 2.2                    | 227,514 |
| 15期(2016年5月12日) | 19,726    | △14.5     | 135.59                                 | △16.4    | 94.4           | 2.8       | 2.7                    | 270,065 |
| 16期(2017年5月12日) | 24,302    | 23.2      | 163.31                                 | 20.4     | 92.9           | 1.9       | 2.4                    | 332,985 |
| 17期(2018年5月14日) | 26,785    | 10.2      | 176.07                                 | 7.8      | 94.4           | 3.4       | 2.2                    | 337,226 |

(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円換算ベース) は、MSCI Kokusai Index (米ドルベース) をもとに委託会社が計算したものです。また、MSCI Kokusai Indexに対する著作権及びその他の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) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | MSCI Kokusai Index<br>(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 |
|---------------------|---------|-------|--|-------|-----------|-----------|---------------------|
|                     | 円       | 騰 落 率 | (円換算ベース)                               | 騰 落 率 |           |           |                     |
| (期 首)<br>2017年5月12日 | 24,302  | —     | 163.31                                 | —     | 92.9      | 1.9       | 2.4                 |
| 5月末                 | 23,936  | △ 1.5 | 160.55                                 | △ 1.7 | 94.5      | 3.2       | 2.4                 |
| 6月末                 | 24,310  | 0.0   | 162.71                                 | △ 0.4 | 94.5      | 3.3       | 2.5                 |
| 7月末                 | 24,494  | 0.8   | 163.87                                 | 0.3   | 94.7      | 2.9       | 2.5                 |
| 8月末                 | 24,402  | 0.4   | 162.88                                 | △ 0.3 | 91.8      | 6.1       | 2.4                 |
| 9月末                 | 25,538  | 5.1   | 170.16                                 | 4.2   | 93.4      | 4.5       | 2.4                 |
| 10月末                | 26,130  | 7.5   | 173.90                                 | 6.5   | 94.7      | 4.4       | 2.4                 |
| 11月末                | 26,309  | 8.3   | 174.81                                 | 7.0   | 94.0      | 3.4       | 2.4                 |
| 12月末                | 27,124  | 11.6  | 179.96                                 | 10.2  | 94.0      | 3.7       | 2.4                 |
| 2018年1月末            | 27,431  | 12.9  | 181.88                                 | 11.4  | 96.5      | 1.4       | 2.2                 |
| 2月末                 | 26,196  | 7.8   | 173.38                                 | 6.2   | 93.2      | 5.0       | 2.1                 |
| 3月末                 | 25,086  | 3.2   | 165.65                                 | 1.4   | 92.9      | 5.1       | 2.2                 |
| 4月末                 | 26,212  | 7.9   | 172.74                                 | 5.8   | 95.0      | 2.8       | 2.2                 |
| (期 末)<br>2018年5月14日 | 26,785  | 10.2  | 176.07                                 | 7.8   | 94.4      | 3.4       | 2.2                 |

(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

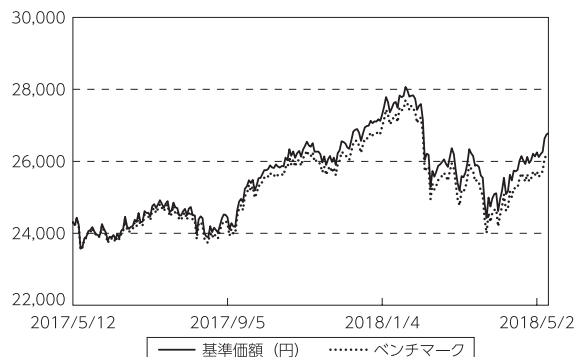
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ10.2%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(7.8%)を2.4%上回りました。

## 基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて4.1%の円高・米ドル安、5.6%の円安・ユーロ高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

●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7.8%の上昇となったため、カイ離は2.4%程度となりました。

|                 | 組入比率<br>要因 | 銘柄選択<br>要因 | その他の<br>要因 | 合計     |
|-----------------|------------|------------|------------|--------|
| ベンチマーク<br>とのカイ離 | 0.0%程度     | △0.0%程度    | 2.4%程度     | 2.4%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△0.0%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2.4%程度でした。

- ・その他の要因としては、配当・利子収入、為替効果、売買コスト、保管料等による影響などが含まれます。

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。

ファンド：株価 (現地通貨建て前日終値) を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

ベンチマーク：株価 (現地通貨建て前日終値) を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートをを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式 (先物・REITを含む) に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。



○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年5月13日～2018年5月14日)

| 項 目  | 当 期                               |   | 項 目 の 概 要  |
|--|-----------------------------------|---|--|
|  | 金 額                               | 比 率   |  |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>( 株 式 )<br>( 投 資 信 託 証 券 )<br>( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ) | 円<br>2<br>( 1 )<br>( 0 )<br>( 1 ) | %<br>0.009<br>(0.005)<br>(0.000)<br>(0.004) | (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<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税<br>( 株 式 )<br>( 投 資 信 託 証 券 )                        | 6<br>( 6 )<br>( 0 )               | 0.024<br>(0.024)<br>(0.000)                 | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (c) そ の 他 費 用<br>( 保 管 費 用 )<br>( そ の 他 )                              | 7<br>( 7 )<br>( 0 )               | 0.029<br>(0.029)<br>(0.000)                 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>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<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計  | 15                                | 0.062                                       |  |
| 期中の平均基準価額は、25,597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

(2017年5月13日～2018年5月14日)

## 株式

|        |         | 買 付                       |                                 | 売 付                       |                                |
|--------|---------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|--------------------------------|
|        |         | 株 数                       | 金 額                             | 株 数                       | 金 額                            |
| 外<br>国 | アメリカ    | 百株<br>119,578<br>( 1,330) | 千アメリカドル<br>882,334<br>(△ 9)     | 百株<br>136,672<br>( 1,176) | 千アメリカドル<br>993,299<br>( 9,274) |
|        | カナダ     | 15,098<br>(△ 384)         | 千カナダドル<br>65,593<br>( -)        | 17,412                    | 千カナダドル<br>70,440               |
|        | ユーロ     |                           | 千ユーロ                            |                           | 千ユーロ                           |
|        | ドイツ     | 9,852<br>( 155)           | 52,079<br>(△ 336)               | 10,098                    | 51,686                         |
|        | イタリア    | 22,165<br>(△ 4,433)       | 10,881<br>( -)                  | 23,560                    | 10,564                         |
|        | フランス    | 10,501<br>( 39)           | 49,636<br>(△ 93)                | 11,012                    | 51,019                         |
|        | オランダ    | 7,988                     | 20,340                          | 8,369                     | 21,512                         |
|        | スペイン    | 21,020<br>( 38,562)       | 17,152<br>( 274)                | 59,683<br>( 6,702)        | 17,474<br>( 104)               |
|        | ベルギー    | 690<br>( 85)              | 5,156<br>( -)                   | 767                       | 5,539                          |
|        | オーストリア  | 283<br>( -)               | 1,148<br>(△ 25)                 | 311                       | 1,328                          |
|        | ルクセンブルク | 720<br>(△ 1,021)          | 1,852<br>( -)                   | 720                       | 1,842                          |
|        | フィンランド  | 3,530<br>( 268)           | 4,958<br>( -)                   | 3,909                     | 5,328                          |
|        | アイルランド  | 2,017<br>( 785)           | 2,676<br>( 565)                 | 1,922<br>( 23,564)        | 2,428<br>( 565)                |
|        | ポルトガル   | 750                       | 583                             | 977                       | 666                            |
|        | イギリス    | 47                        | 170                             | 230                       | 762                            |
|        | イギリス    | 129,917<br>( 156,160)     | 千イギリスポンド<br>76,928<br>(△ 100)   | 131,553<br>(186,382)      | 千イギリスポンド<br>78,388<br>( 118)   |
|        | スイス     | 6,920<br>( 1,757)         | 千スイスフラン<br>44,718<br>(△ 433)    | 9,072                     | 千スイスフラン<br>53,018              |
|        | スウェーデン  | 9,106<br>( 1,670)         | 千スウェーデンクローネ<br>127,961<br>( -)  | 10,662                    | 千スウェーデンクローネ<br>139,808         |
|        | ノルウェー   | 2,181<br>( -)             | 千ノルウェークローネ<br>29,910<br>(△ 333) | 2,454                     | 千ノルウェークローネ<br>34,332           |

|        |          | 買 付                |                               | 売 付                |                               |
|--------|----------|--------------------|-------------------------------|--------------------|-------------------------------|
|        |          | 株 数                | 金 額                           | 株 数                | 金 額                           |
| 外<br>国 | デンマーク    | 百株<br>1,922        | 千デンマーククローネ<br>69,689          | 百株<br>2,669        | 千デンマーククローネ<br>74,510          |
|        | オーストラリア  | 26,811<br>(△ 0.89) | 千オーストラリアドル<br>45,625<br>( - ) | 29,932<br>( - )    | 千オーストラリアドル<br>49,073<br>( 31) |
|        | ニュージーランド | 2,353              | 千ニュージーランドドル<br>1,875          | 3,021              | 千ニュージーランドドル<br>1,714          |
|        | 香港       | 47,041<br>( 3,231) | 千香港ドル<br>138,976<br>( - )     | 47,374             | 千香港ドル<br>150,117              |
|        | シンガポール   | 15,116             | 千シンガポールドル<br>9,548            | 16,301<br>( 2,421) | 千シンガポールドル<br>10,487<br>( 723) |
|        | イスラエル    | 2,066              | 千イスラエルシケル<br>4,987            | 2,096              | 千イスラエルシケル<br>5,376            |

(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                      | 15   | 424     | 17 | 406     |
| MACERICH CO/THE              | 2    | 165     | 3  | 229     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 6    | 739     | 4  | 600     |
| PROLOGIS INC                 | 19   | 1,238   | 21 | 1,349   |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 2    | 214     | 2  | 216     |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 4    | 168     | 5  | 203     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 10   | 1,222   | 7  | 806     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 2    | 672     | 2  | 700     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 6    | 505     | 6  | 544     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 3    | 412     | 3  | 389     |
| WELLTOWER INC                | 16   | 1,034   | 17 | 993     |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 4    | 587     | 5  | 656     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 4    | 424     | 4  | 430     |
| REALTY INCOME CORP           | 13   | 706     | 12 | 626     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 6    | 407     | 6  | 423     |
| SL GREEN REALTY CORP         | 5    | 518     | 5  | 538     |
| UDR INC                      | 7    | 297     | 8  | 313     |
| VENTAS INC                   | 13   | 781     | 14 | 783     |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 48   | 555     | 41 | 434     |
| WEYERHAEUSER CO              | 30   | 1,044   | 32 | 1,142   |
| AMERICAN TOWER CORP          | 15   | 2,224   | 17 | 2,467   |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 24   | 482     | 20 | 398     |
| VEREIT INC                   | 33   | 261     | 33 | 235     |
| DUKE REALTY CORP             | 11   | 329     | 11 | 312     |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 8    | 156     | 12 | 207     |
| IRON MOUNTAIN INC            | 16   | 575     | 15 | 499     |
| EQUINIX INC                  | 2    | 1,278   | 3  | 1,356   |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 19   | 2,011   | 17 | 1,853   |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 12   | 800     | 14 | 865     |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 33   | 238     | 30 | 198     |
| INVITATION HOMES INC         | 46   | 1,065   | 20 | 451     |
| JBG SMITH PROPERTIES         | —    | —       | 7  | 255     |
|                              | ( 7) | ( —)    |    |         |
| GGP INC                      | 22   | 481     | 24 | 503     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 22   | 428     | 24 | 466     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 3    | 163     | 5  | 221     |
| PUBLIC STORAGE               | 6    | 1,358   | 6  | 1,281   |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 12   | 1,952   | 13 | 2,170   |
| VORNADO REALTY TRUST         | 5    | 419     | 6  | 412     |
| KIMCO REALTY CORP            | 6    | 129     | 9  | 158     |

| 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    |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 4            | 801            | 5     | 864        |
| 小 計                          | 535<br>( 7)  | 27,285<br>( -) | 524   | 26,968     |
| カナダ                          |              | 千カナダドル         |       | 千カナダドル     |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 0.6          | 18             | 0.5   | 15         |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 2            | 48             | 2     | 47         |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 2            | 49             | 1     | 45         |
| 小 計                          | 4            | 117            | 4     | 109        |
| ユーロ                          |              | 千ユーロ           |       | 千ユーロ       |
| フランス                         |              |                |       |            |
| GECINA SA                    | 2            | 283            | 1     | 270        |
| GECINA SA-RTS                | -<br>( 3)    | -<br>( -)      | 3     | 9          |
| KLEPIERRE                    | 8            | 300            | 8     | 295        |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 3            | 700            | 3     | 742        |
| FONCIERE DES REGIONS         | 1<br>( -)    | 110<br>(△ 2)   | 0.707 | 63         |
| ICADE                        | 1            | 100            | 1     | 103        |
| 小 計                          | 16<br>( 3)   | 1,496<br>(△ 2) | 20    | 1,484      |
| ユ ー ロ 計                      | 16<br>( 3)   | 1,496<br>(△ 2) | 20    | 1,484      |
| イギリス                         |              | 千イギリスポンド       |       | 千イギリスポンド   |
| BRITISH LAND CO PLC          | 41           | 263            | 44    | 294        |
| HAMMERSON PLC                | 8            | 49             | 16    | 89         |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 30<br>(△ 4)  | 302<br>(△ 46)  | 30    | 293        |
| INTU PROPERTIES PLC          | 8            | 22             | 91    | 189        |
| SEGRO PLC                    | 32           | 184            | 38    | 220        |
| 小 計                          | 121<br>(△ 4) | 822<br>(△ 46)  | 221   | 1,088      |
| 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             | 134          | 357            | 167   | 437        |
| SCENTRE GROUP                | 215          | 854            | 240   | 938        |
| GPT GROUP                    | 42           | 210            | 52    | 252        |
| MIRVAC GROUP                 | 95           | 221            | 115   | 265        |
| STOCKLAND                    | 187          | 797            | 198   | 822        |
| WESTFIELD CORP               | 75           | 632            | 83    | 710        |
| DEXUS                        | 43           | 411            | 47    | 459        |
| GOODMAN GROUP                | 61           | 523            | 66    | 547        |
| 小 計                          | 855          | 4,008          | 971   | 4,433      |
| 香港                           |              | 千香港ドル          |       | 千香港ドル      |
| LINK REIT                    | 86           | 5,626          | 100   | 6,559      |
| 小 計                          | 86           | 5,626          | 100   | 6,559      |

外 国

| 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                  | 106<br>( - ) | 200<br>(△ 2)      | 84  | 154       |
|    | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 210<br>( - ) | 351<br>(△0.33132) | 189 | 322       |
|    | CAPITACOMMERCIAL TRUST-RTS   | -<br>( 31)   | -<br>( - )        | 31  | 8         |
|    | CAPITALAND MALL TRUST        | 42           | 83                | 84  | 171       |
|    | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 139<br>( - ) | 369<br>(△ 2)      | 152 | 401       |
| 小計 |                              | 498<br>( 31) | 1,004<br>(△ 5)    | 542 | 1,058     |

(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<br>243,505 | 百万円<br>240,136 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

(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

(2017年5月13日～2018年5月14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       | 316,730,772千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 339,953,187千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.93          |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

### ○利害関係人との取引状況等

(2017年5月13日～2018年5月14日)

#### 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A      |         |     | 売付額等<br>C      |         |     |
|--------|----------------|---------|-----|----------------|---------|-----|
|        | うち利害関係人との取引状況B | B/A     | %   | うち利害関係人との取引状況D | D/C     | %   |
| 為替直物取引 | 百万円<br>3,608   | 208,023 | 1.7 | 百万円<br>8,888   | 226,799 | 3.9 |

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

## ○組入資産の明細

(2018年5月14日現在)

## 外国株式

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |           | 業 種 等                  |
|------------------------------|---------|-------|---------|-----------|------------------------|
|                              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |           |                        |
|                              |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千アメリカドル | 千円        |                        |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 653     | 590   | 5,984   | 654,220   | 各種金融                   |
| ABBOTT LABORATORIES          | 1,444   | 1,391 | 8,527   | 932,095   | ヘルスケア機器・サービス           |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 274     | 257   | 1,788   | 195,505   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 46      | 46    | 762     | 83,331    | 各種金融                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 379     | 354   | 4,516   | 493,712   | ソフトウェア・サービス            |
| AUTONATION INC               | 61      | 40    | 187     | 20,494    | 小売                     |
| AES CORP                     | 549     | 515   | 633     | 69,227    | 公益事業                   |
| AFLAC INC                    | 342     | 628   | 2,844   | 310,978   | 保険                     |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 861     | 718   | 3,796   | 415,027   | 保険                     |
| APACHE CORP                  | 319     | 303   | 1,258   | 137,538   | エネルギー                  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 671     | 630   | 753     | 82,350    | 半導体・半導体製造装置            |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 44      | 41    | 856     | 93,651    | ソフトウェア・サービス            |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 520     | 491   | 7,722   | 844,097   | ソフトウェア・サービス            |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 173     | 175   | 2,911   | 318,263   | 素材                     |
| ANTHEM INC                   | 221     | 205   | 4,763   | 520,751   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 469     | 437   | 2,988   | 326,679   | エネルギー                  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 1,144   | 1,097 | 3,288   | 359,510   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 411     | 391   | 2,762   | 301,943   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BOEING CO/THE                | 492     | 452   | 15,504  | 1,694,800 | 資本財                    |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 178     | 211   | 4,769   | 521,398   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BEST BUY CO INC              | 238     | 215   | 1,675   | 183,127   | 小売                     |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 1,403   | 1,309 | 6,790   | 742,274   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                | 101     | 96    | 5,192   | 567,645   | 各種金融                   |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 3,420   | 3,300 | 16,047  | 1,754,191 | 電気通信サービス               |
| CR BARD INC                  | 61      | —     | —       | —         | ヘルスケア機器・サービス           |
| BALL CORP                    | 142     | 268   | 1,034   | 113,117   | 素材                     |
| BAKER HUGHES INC             | 337     | —     | —       | —         | エネルギー                  |
| ALLSTATE CORP                | 309     | 287   | 2,766   | 302,436   | 保険                     |
| AVERY DENNISON CORP          | 75      | 72    | 780     | 85,351    | 素材                     |
| CHUBB LTD                    | 389     | 371   | 5,056   | 552,744   | 保険                     |
| ANALOG DEVICES INC           | 306     | 295   | 2,731   | 298,622   | 半導体・半導体製造装置            |
| AUTOZONE INC                 | 24      | 21    | 1,453   | 158,852   | 小売                     |
| CVS HEALTH CORP              | 894     | 810   | 5,217   | 570,314   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CORNING INC                  | 801     | 695   | 1,948   | 213,008   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 3,001   | 2,775 | 31,606  | 3,454,895 | 銀行                     |
| CIGNA CORP                   | 215     | 197   | 3,423   | 374,225   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CATERPILLAR INC              | 491     | 475   | 7,369   | 805,608   | 資本財                    |
| COCA-COLA CO/THE             | 3,436   | 3,237 | 13,643  | 1,491,421 | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 405     | 387   | 3,587   | 392,176   | 各種金融                   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 165     | 143   | 582     | 63,694    | 食品・飲料・タバコ              |
| CSX CORP                     | 787     | 679   | 4,287   | 468,649   | 運輸                     |
| CHEVRON CORP                 | 1,584   | 1,519 | 19,734  | 2,157,165 | エネルギー                  |
| TAPESTRY INC                 | 237     | 228   | 1,051   | 114,900   | 耐久消費財・アパレル             |
| ROCKWELL COLLINS INC         | 135     | 130   | 1,750   | 191,299   | 資本財                    |
| CONOCOPHILLIPS               | 1,039   | 956   | 6,638   | 725,703   | エネルギー                  |
| CME GROUP INC                | 284     | 272   | 4,333   | 473,675   | 各種金融                   |

| 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        |              |
| CARDINAL HEALTH INC         | 269     | 251   | 1,388   | 151,792   | ヘルスケア機器・サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE CO        | 709     | 666   | 4,181   | 457,107   | 家庭用品・パーソナル用品 |
| DOMINION ENERGY INC         | 528     | 517   | 3,345   | 365,697   | 公益事業         |
| DOW CHEMICAL CO/THE         | 941     | —     | —       | —         | 素材           |
| DEVON ENERGY CORP           | 396     | 398   | 1,630   | 178,212   | エネルギー        |
| DEERE & CO                  | 225     | 218   | 3,218   | 351,765   | 資本財          |
| DANAHER CORP                | 522     | 500   | 5,094   | 556,843   | ヘルスケア機器・サービス |
| DU PONT (E. I.) DE NEMOURS  | 729     | —     | —       | —         | 素材           |
| WALT DISNEY CO/THE          | 1,268   | 1,207 | 12,320  | 1,346,783 | メディア         |
| DARDEN RESTAURANTS INC      | 95      | 100   | 905     | 98,947    | 消費者サービス      |
| DUKE ENERGY CORP            | 579     | 561   | 4,378   | 478,592   | 公益事業         |
| DR HORTON INC               | 293     | 285   | 1,251   | 136,827   | 耐久消費財・アパレル   |
| DICK'S SPORTING GOODS INC   | 69      | —     | —       | —         | 小売           |
| TARGET CORP                 | 448     | 413   | 2,901   | 317,197   | 小売           |
| DUN & BRADSTREET CORP       | 29      | —     | —       | —         | 商業・専門サービス    |
| DAVITA INC                  | 132     | 113   | 748     | 81,817    | ヘルスケア機器・サービス |
| DOVER CORP                  | 129     | 114   | 884     | 96,670    | 資本財          |
| DTE ENERGY COMPANY          | 153     | 145   | 1,487   | 162,561   | 公益事業         |
| EXXON MOBIL CORP            | 3,479   | 3,390 | 27,557  | 3,012,363 | エネルギー        |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 179     | 169   | 2,336   | 255,422   | ヘルスケア機器・サービス |
| EOG RESOURCES INC           | 483     | 462   | 5,425   | 593,037   | エネルギー        |
| EMERSON ELECTRIC CO         | 540     | 513   | 3,694   | 403,810   | 資本財          |
| EXELON CORP                 | 778     | 771   | 3,135   | 342,772   | 公益事業         |
| ECOLAB INC                  | 220     | 208   | 3,066   | 335,178   | 素材           |
| EQUIFAX INC                 | 100     | 96    | 1,103   | 120,672   | 商業・専門サービス    |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 187     | 179   | 2,518   | 275,283   | 家庭用品・パーソナル用品 |
| EATON CORP PLC              | 379     | 351   | 2,690   | 294,092   | 資本財          |
| EDISON INTERNATIONAL        | 276     | 261   | 1,631   | 178,380   | 公益事業         |
| ENTERGY CORP                | 152     | 146   | 1,154   | 126,166   | 公益事業         |
| EVEREST RE GROUP LTD        | 34      | 34    | 777     | 85,019    | 保険           |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO   | 46      | —     | —       | —         | 家庭用品・パーソナル用品 |
| NEXTERA ENERGY INC          | 393     | 377   | 6,066   | 663,180   | 公益事業         |
| MACY'S INC                  | 250     | 238   | 706     | 77,256    | 小売           |
| FEDEX CORP                  | 212     | 203   | 5,115   | 559,131   | 運輸           |
| FORD MOTOR CO               | 3,120   | 2,964 | 3,317   | 362,586   | 自動車・自動車部品    |
| FRANKLIN RESOURCES INC      | 309     | 271   | 903     | 98,733    | 各種金融         |
| FOOT LOCKER INC             | 109     | —     | —       | —         | 小売           |
| FIRSTENERGY CORP            | 357     | 359   | 1,225   | 133,916   | 公益事業         |
| FLUOR CORP                  | 118     | 112   | 522     | 57,137    | 資本財          |
| FREEMPORT-MCMORAN INC       | 1,083   | 1,100 | 1,790   | 195,722   | 素材           |
| GENERAL MILLS INC           | 497     | 454   | 1,936   | 211,707   | 食品・飲料・タバコ    |
| GENERAL DYNAMICS CORP       | 217     | 202   | 4,137   | 452,274   | 資本財          |
| WW GRAINGER INC             | 46      | 43    | 1,281   | 140,124   | 資本財          |
| GENERAL ELECTRIC CO         | 7,422   | 6,936 | 10,127  | 1,107,081 | 資本財          |
| GLOBAL PAYMENTS INC         | 128     | 127   | 1,478   | 161,571   | ソフトウェア・サービス  |
| GENUINE PARTS CO            | 123     | 117   | 1,070   | 117,068   | 小売           |
| TEGNA INC                   | 173     | —     | —       | —         | メディア         |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO   | 214     | 192   | 492     | 53,833    | 自動車・自動車部品    |
| GAP INC/THE                 | 201     | 185   | 541     | 59,230    | 小売           |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC     | 300     | 286   | 6,962   | 761,025   | 各種金融         |
| HALLIBURTON CO              | 725     | 698   | 3,652   | 399,253   | エネルギー        |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 607     | 578   | 8,528   | 932,213   | 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        |                        |
| HARLEY-DAVIDSON INC          | 146     | 138   | 566     | 61,888    | 自動車・自動車部品              |
| HP INC                       | 1,439   | 1,337 | 3,037   | 332,010   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 317     | 285   | 1,499   | 163,891   | 保険                     |
| HERSHEY CO/THE               | 120     | 114   | 1,059   | 115,813   | 食品・飲料・タバコ              |
| HOME DEPOT INC               | 1,022   | 934   | 17,782  | 1,943,833 | 小売                     |
| HASBRO INC                   | 93      | 91    | 795     | 86,913    | 耐久消費財・アパレル             |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 217     | 199   | 1,772   | 193,721   | 資本財                    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 757     | 703   | 10,139  | 1,108,383 | ソフトウェア・サービス            |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 329     | 313   | 1,683   | 184,033   | 素材                     |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 265     | 246   | 3,594   | 392,909   | 資本財                    |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 326     | 316   | 768     | 84,037    | メディア                   |
| IDEX CORP                    | —       | 62    | 869     | 95,001    | 資本財                    |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 65      | 65    | 832     | 91,038    | 素材                     |
| JOHNSON & JOHNSON            | 2,282   | 2,149 | 27,349  | 2,989,612 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 88      | 84    | 931     | 101,784   | 運輸                     |
| KELLOGG CO                   | 222     | 207   | 1,271   | 139,015   | 食品・飲料・タバコ              |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 301     | 281   | 2,948   | 322,269   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 1,296   | 1,194 | 4,687   | 512,345   | 食品・飲料・タバコ              |
| KROGER CO                    | 753     | 704   | 1,731   | 189,235   | 食品・生活必需品小売り            |
| KOHL'S CORP                  | 153     | 138   | 832     | 90,954    | 小売                     |
| ELI LILLY & CO               | 834     | 792   | 6,535   | 714,429   | 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 | 85      | 81    | 1,429   | 156,260   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 128     | 127   | 666     | 72,878    | 運輸                     |
| LENNAR CORP-A                | 167     | 228   | 1,240   | 135,619   | 耐久消費財・アパレル             |
| LOWE'S COS INC               | 730     | 664   | 5,813   | 635,512   | 小売                     |
| LEGGETT & PLATT INC          | 113     | 99    | 415     | 45,438    | 耐久消費財・アパレル             |
| L BRANDS INC                 | 201     | 201   | 652     | 71,280    | 小売                     |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 367     | 315   | 2,467   | 269,722   | 消費者サービス                |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 221     | 206   | 6,689   | 731,227   | 資本財                    |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 193     | 174   | 1,187   | 129,852   | 保険                     |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | —       | 30    | 623     | 68,180    | 資本財                    |
| L3 TECHNOLOGIES INC          | 64      | 62    | 1,225   | 133,930   | 資本財                    |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 279     | 247   | 3,463   | 378,562   | 消費者サービス                |
| MCDONALD'S CORP              | 697     | 637   | 10,546  | 1,152,793 | 消費者サービス                |
| S&P GLOBAL INC               | 218     | 204   | 4,080   | 446,049   | 各種金融                   |
| MEDTRONIC PLC                | 1,168   | 1,082 | 9,260   | 1,012,246 | ヘルスケア機器・サービス           |
| MERCK & CO. INC.             | 2,314   | 2,179 | 13,009  | 1,422,100 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 875     | 922   | 4,780   | 522,533   | 半導体・半導体製造装置            |
| MATTEL INC                   | 278     | 248   | 369     | 40,391    | 耐久消費財・アパレル             |
| 3M CO                        | 504     | 476   | 9,773   | 1,068,376 | 資本財                    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 124     | 129   | 1,400   | 153,132   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 382     | 361   | 1,150   | 125,770   | 消費者サービス                |
| MASCO CORP                   | 274     | 251   | 957     | 104,684   | 資本財                    |
| MONSANTO CO                  | 367     | 352   | 4,405   | 481,613   | 素材                     |
| M & T BANK CORP              | 117     | 108   | 2,008   | 219,583   | 銀行                     |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 433     | 408   | 3,334   | 364,503   | 保険                     |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 52      | 50    | 1,081   | 118,179   | 耐久消費財・アパレル             |
| MORGAN STANLEY               | 1,180   | 1,084 | 5,985   | 654,311   | 各種金融                   |
| MCKESSON CORP                | 189     | 166   | 2,485   | 271,710   | ヘルスケア機器・サービス           |
| METLIFE INC                  | 784     | 714   | 3,342   | 365,354   | 保険                     |
| MANPOWERGROUP INC            | 57      | 52    | 505     | 55,249    | 商業・専門サービス              |
| MOODY'S CORP                 | 145     | 137   | 2,395   | 261,865   | 各種金融                   |

| 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        |                        |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 245     | 229   | 3,491   | 381,604   | 運輸                     |
| BANK OF AMERICA CORP         | 8,478   | 7,927 | 24,510  | 2,679,246 | 銀行                     |
| NISOURCE INC                 | 280     | 285   | 712     | 77,856    | 公益事業                   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 140     | 132   | 4,305   | 470,581   | 資本財                    |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 415     | 373   | 436     | 47,742    | 銀行                     |
| NEWMONT MINING CORP          | 447     | 431   | 1,741   | 190,318   | 素材                     |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 889     | 842   | 3,197   | 349,486   | メディア                   |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 94      | 95    | 1,026   | 112,152   | 食品・飲料・タバコ              |
| MARKEL CORP                  | 11      | 11    | 1,294   | 141,517   | 保険                     |
| NUCOR CORP                   | 267     | 255   | 1,613   | 176,334   | 素材                     |
| NEWELL BRANDS INC            | 366     | 392   | 1,060   | 115,974   | 耐久消費財・アパレル             |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 368     | 350   | 1,313   | 143,630   | メディア                   |
| NOBLE ENERGY INC             | 390     | 369   | 1,286   | 140,624   | エネルギー                  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 642     | 612   | 5,205   | 569,015   | エネルギー                  |
| OMNICOM GROUP                | 199     | 183   | 1,375   | 150,409   | メディア                   |
| PEPSICO INC                  | 1,203   | 1,137 | 11,083  | 1,211,573 | 食品・飲料・タバコ              |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 79      | 76    | 897     | 98,144    | 素材                     |
| ALTRIA GROUP INC             | 1,635   | 1,526 | 8,422   | 920,668   | 食品・飲料・タバコ              |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 93      | 94    | 736     | 80,542    | 公益事業                   |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 2,144   | 2,028 | 14,882  | 1,626,751 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 408     | 380   | 5,743   | 627,789   | 銀行                     |
| PFIZER INC                   | 5,092   | 4,768 | 16,926  | 1,850,271 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 361     | 338   | 3,382   | 369,745   | 保険                     |
| PULTEGROUP INC               | 253     | 198   | 621     | 67,906    | 耐久消費財・アパレル             |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 112     | 106   | 1,863   | 203,674   | 資本財                    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 142     | 135   | 2,747   | 300,372   | エネルギー                  |
| CITIGROUP INC                | 2,390   | 2,114 | 15,407  | 1,684,192 | 銀行                     |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 241     | 230   | 1,360   | 148,738   | 保険                     |
| PPG INDUSTRIES INC           | 222     | 203   | 2,046   | 223,687   | 素材                     |
| PENTAIR PLC                  | 146     | 146   | 656     | 71,719    | 資本財                    |
| PRAXAIR INC                  | 240     | 229   | 3,613   | 395,027   | 素材                     |
| P G & E CORP                 | 427     | 412   | 1,786   | 195,265   | 公益事業                   |
| PPL CORP                     | 576     | 554   | 1,541   | 168,535   | 公益事業                   |
| PROGRESSIVE CORP             | 488     | 465   | 2,908   | 317,933   | 保険                     |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 429     | 407   | 2,084   | 227,813   | 公益事業                   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 144     | 136   | 1,462   | 159,824   | 消費者サービス                |
| RAYTHEON COMPANY             | 246     | 231   | 4,944   | 540,494   | 資本財                    |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 201     | 187   | 1,271   | 138,933   | 商業・専門サービス              |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 1,037   | 926   | 1,790   | 195,666   | 銀行                     |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD   | 34      | 30    | 386     | 42,254    | 保険                     |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 85      | 81    | 2,287   | 250,006   | 資本財                    |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 345     | 338   | 901     | 98,579    | 公益事業                   |
| ROBERT HALF INTL INC         | 109     | 98    | 621     | 67,952    | 商業・専門サービス              |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 108     | 102   | 1,826   | 199,646   | 資本財                    |
| SCHLUMBERGER LTD             | 1,166   | 1,108 | 7,876   | 860,927   | エネルギー                  |
| STRYKER CORP                 | 282     | 269   | 4,563   | 498,845   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 1,002   | 964   | 5,736   | 627,098   | 各種金融                   |
| SEMPRA ENERGY                | 201     | 192   | 2,058   | 225,015   | 公益事業                   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 66      | 67    | 2,569   | 280,851   | 素材                     |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 127     | 122   | 1,759   | 192,311   | 資本財                    |
| SUNTRUST BANKS INC           | 412     | 380   | 2,632   | 287,751   | 銀行                     |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 238     | 218   | 2,872   | 314,040   | 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        |                        |
| SOUTHERN CO/THE                | 826     | 806   | 3,625   | 396,268   | 公益事業                   |
| AT&T INC                       | 5,150   | 4,911 | 15,858  | 1,733,502 | 電気通信サービス               |
| WESTERN DIGITAL CORP           | 240     | 236   | 1,864   | 203,832   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| STATE STREET CORP              | 324     | 296   | 3,021   | 330,328   | 各種金融                   |
| SYSCO CORP                     | 436     | 396   | 2,488   | 272,009   | 食品・生活必需品小売り            |
| SEALED AIR CORP                | 158     | 135   | 602     | 65,849    | 素材                     |
| SCANA CORP                     | 113     | 98    | 347     | 37,946    | 公益事業                   |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 838     | 788   | 8,616   | 941,827   | 半導体・半導体製造装置            |
| TIFFANY & CO                   | 103     | 100   | 1,040   | 113,726   | 小売                     |
| TORCHMARK CORP                 | 96      | 90    | 778     | 85,049    | 保険                     |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 787     | 739   | 2,683   | 293,366   | 資本財                    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC   | 332     | 320   | 6,947   | 759,462   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXTRON INC                    | 224     | 210   | 1,385   | 151,424   | 資本財                    |
| UNION PACIFIC CORP             | 691     | 630   | 8,968   | 980,397   | 運輸                     |
| UNUM GROUP                     | 192     | 188   | 713     | 78,009    | 保険                     |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP       | 656     | 606   | 7,551   | 825,422   | 資本財                    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC         | 807     | 775   | 18,471  | 2,019,167 | ヘルスケア機器・サービス           |
| US BANCORP                     | 1,424   | 1,326 | 6,831   | 746,782   | 銀行                     |
| MARATHON OIL CORP              | 701     | 679   | 1,425   | 155,867   | エネルギー                  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B     | 579     | 549   | 6,349   | 694,053   | 運輸                     |
| VALERO ENERGY CORP             | 380     | 350   | 4,016   | 439,008   | エネルギー                  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC     | 79      | 75    | 891     | 97,434    | ヘルスケア機器・サービス           |
| VALSPAR CORP/THE               | 62      | —     | —       | —         | 素材                     |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING    | 330     | 274   | 1,442   | 157,664   | メディア                   |
| VF CORP                        | 279     | 269   | 2,098   | 229,399   | 耐久消費財・アパレル             |
| VULCAN MATERIALS CO            | 111     | 105   | 1,348   | 147,386   | 素材                     |
| WILLIAMS COS INC               | 686     | 662   | 1,797   | 196,539   | エネルギー                  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | 772     | 672   | 4,312   | 471,405   | 食品・生活必需品小売り            |
| WEC ENERGY GROUP INC           | 268     | 255   | 1,578   | 172,539   | 公益事業                   |
| WALMART INC                    | 1,296   | 1,194 | 9,962   | 1,089,054 | 食品・生活必需品小売り            |
| WELLS FARGO & CO               | 4,002   | 3,742 | 20,377  | 2,227,438 | 銀行                     |
| WASTE MANAGEMENT INC           | 372     | 347   | 2,882   | 315,118   | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                    | 68      | 63    | 1,251   | 136,773   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL   | 796     | —     | —       | —         | エネルギー                  |
| WHIRLPOOL CORP                 | 62      | 58    | 911     | 99,668    | 耐久消費財・アパレル             |
| XEROX CORP                     | 733     | 163   | 491     | 53,758    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| XCEL ENERGY INC                | 431     | 409   | 1,855   | 202,802   | 公益事業                   |
| KEYCORP                        | 910     | 859   | 1,741   | 190,317   | 銀行                     |
| CARMAX INC                     | 158     | 148   | 945     | 103,333   | 小売                     |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC     | 168     | 161   | 1,883   | 205,850   | ヘルスケア機器・サービス           |
| TOLL BROTHERS INC              | 132     | 118   | 505     | 55,207    | 耐久消費財・アパレル             |
| YUM! BRANDS INC                | 294     | 255   | 2,165   | 236,739   | 消費者サービス                |
| TJX COMPANIES INC              | 547     | 505   | 4,252   | 464,796   | 小売                     |
| CA INC                         | 258     | 255   | 903     | 98,783    | ソフトウェア・サービス            |
| CLOROX COMPANY                 | 108     | 102   | 1,240   | 135,570   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| CELANESE CORP-SERIES A         | 118     | 108   | 1,173   | 128,314   | 素材                     |
| CADENCE DESIGN SYS INC         | 238     | 227   | 960     | 105,039   | ソフトウェア・サービス            |
| CARNIVAL CORP                  | 293     | 277   | 1,775   | 194,118   | 消費者サービス                |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV    | 263     | 266   | 2,799   | 306,037   | ソフトウェア・サービス            |
| CONAGRA BRANDS INC             | 347     | 326   | 1,235   | 135,031   | 食品・飲料・タバコ              |
| CONSOLIDATED EDISON INC        | 258     | 250   | 1,921   | 210,091   | 公益事業                   |
| FIFTH THIRD BANCORP            | 635     | 563   | 1,916   | 209,452   | 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        |                        |
| STERICYCLE INC            | 72      | 61    | 394     | 43,101    | 商業・専門サービス              |
| INTEL CORP                | 3,974   | 3,744 | 20,473  | 2,237,931 | 半導体・半導体製造装置            |
| CISCO SYSTEMS INC         | 4,212   | 3,953 | 18,159  | 1,984,992 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CINTAS CORP               | 69      | 72    | 1,330   | 145,406   | 商業・専門サービス              |
| SBA COMMUNICATIONS CORP   | 103     | 94    | 1,506   | 164,679   | 不動産                    |
| COSTCO WHOLESALE CORP     | 366     | 349   | 6,843   | 748,049   | 食品・生活必需品小売り            |
| APPLIED MATERIALS INC     | 908     | 853   | 4,679   | 511,467   | 半導体・半導体製造装置            |
| ELECTRONIC ARTS INC       | 253     | 246   | 3,271   | 357,565   | ソフトウェア・サービス            |
| TYSON FOODS INC-CL A      | 244     | 237   | 1,622   | 177,318   | 食品・飲料・タバコ              |
| SYMANTEC CORP             | 525     | 495   | 967     | 105,803   | ソフトウェア・サービス            |
| ROSS STORES INC           | 333     | 308   | 2,527   | 276,256   | 小売                     |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC  | 182     | 187   | 1,739   | 190,171   | 半導体・半導体製造装置            |
| NIKE INC -CL B            | 1,122   | 1,050 | 7,187   | 785,707   | 耐久消費財・アパレル             |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUS | 12      | —     | —       | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMGEN INC                 | 624     | 538   | 9,368   | 1,024,108 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COMERICA INC              | 147     | 138   | 1,359   | 148,611   | 銀行                     |
| NORTHERN TRUST CORP       | 180     | 172   | 1,878   | 205,355   | 各種金融                   |
| MICROSOFT CORP            | 6,198   | 5,864 | 57,293  | 6,262,787 | ソフトウェア・サービス            |
| ANSYS INC                 | 73      | 67    | 1,168   | 127,757   | ソフトウェア・サービス            |
| CENTENE CORP              | 142     | 162   | 1,854   | 202,752   | ヘルスケア機器・サービス           |
| STAPLES INC               | 549     | —     | —       | —         | 小売                     |
| STARBUCKS CORP            | 1,221   | 1,137 | 6,512   | 711,933   | 消費者サービス                |
| ORACLE CORP               | 2,583   | 2,503 | 11,721  | 1,281,331 | ソフトウェア・サービス            |
| WHOLE FOODS MARKET INC    | 263     | —     | —       | —         | 食品・生活必需品小売り            |
| NETFLIX INC               | 360     | 346   | 11,304  | 1,235,640 | 小売                     |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC   | 79      | 68    | 1,834   | 200,499   | 小売                     |
| ACTIVISION BLIZZARD INC   | 499     | 574   | 4,119   | 450,312   | ソフトウェア・サービス            |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC    | 156     | 146   | 1,425   | 155,838   | 半導体・半導体製造装置            |
| HENRY SCHEIN INC          | 67      | 126   | 925     | 101,178   | ヘルスケア機器・サービス           |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY    | 111     | 100   | 698     | 76,352    | 小売                     |
| LAM RESEARCH CORP         | 137     | 129   | 2,610   | 285,395   | 半導体・半導体製造装置            |
| WYNN RESORTS LTD          | 67      | 77    | 1,522   | 166,429   | 消費者サービス                |
| COMCAST CORP-CLASS A      | 3,999   | 3,729 | 11,895  | 1,300,343 | メディア                   |
| XILINX INC                | 211     | 200   | 1,390   | 152,011   | 半導体・半導体製造装置            |
| PACCAR INC                | 295     | 280   | 1,790   | 195,714   | 資本財                    |
| DENTSPLY SIRONA INC       | 192     | 188   | 882     | 96,498    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALIGN TECHNOLOGY INC      | 60      | 60    | 1,744   | 190,715   | ヘルスケア機器・サービス           |
| GILEAD SCIENCES INC       | 1,105   | 1,044 | 6,909   | 755,304   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CITRIX SYSTEMS INC        | 129     | 117   | 1,258   | 137,563   | ソフトウェア・サービス            |
| INTUITIVE SURGICAL INC    | 32      | 89    | 4,196   | 458,761   | ヘルスケア機器・サービス           |
| INTUIT INC                | 205     | 194   | 3,772   | 412,332   | ソフトウェア・サービス            |
| SVB FINANCIAL GROUP       | —       | 42    | 1,354   | 148,012   | 銀行                     |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 234     | —     | —       | —         | ソフトウェア・サービス            |
| PAYCHEX INC               | 273     | 258   | 1,635   | 178,811   | ソフトウェア・サービス            |
| ALTAFA INC                | 762     | —     | —       | —         | ソフトウェア・サービス            |
| PATTERSON COS INC         | 73      | —     | —       | —         | ヘルスケア機器・サービス           |
| SIGNATURE BANK            | 45      | 43    | 568     | 62,166    | 銀行                     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 109     | 104   | 1,052   | 115,006   | ソフトウェア・サービス            |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | —       | 51    | 760     | 83,109    | 運輸                     |
| AUTODESK INC              | 167     | 157   | 2,150   | 235,054   | ソフトウェア・サービス            |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A      | 208     | 149   | 442     | 48,407    | メディア                   |
| SALESFORCE.COM INC        | 541     | 548   | 7,169   | 783,740   | 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        |                        |
| NORDSTROM INC                | 110     | 94    | 459     | 50,206    | 小売                     |
| ALPHABET INC-CL A            | 248     | 238   | 26,335  | 2,878,730 | ソフトウェア・サービス            |
| EAST WEST BANCORP INC        | —       | 116   | 808     | 88,409    | 銀行                     |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 35      | 32    | 333     | 36,477    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GARMIN LTD                   | 100     | 94    | 558     | 61,005    | 耐久消費財・アパレル             |
| TRIMBLE INC                  | 205     | 206   | 714     | 78,063    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| QUALCOMM INC                 | 1,239   | 1,179 | 6,514   | 712,098   | 半導体・半導体製造装置            |
| HOLOGIC INC                  | 208     | 226   | 866     | 94,768    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SYNOPSYS INC                 | 125     | 120   | 1,099   | 120,208   | ソフトウェア・サービス            |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 235     | 225   | 1,298   | 141,980   | 半導体・半導体製造装置            |
| AMAZON.COM INC               | 338     | 327   | 52,536  | 5,742,817 | 小売                     |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 204     | 193   | 2,287   | 250,052   | 各種金融                   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 115     | 109   | 1,118   | 122,261   | ヘルスケア機器・サービス           |
| KLA-TENCOR CORP              | 131     | 125   | 1,393   | 152,297   | 半導体・半導体製造装置            |
| STEEL DYNAMICS INC           | —       | 191   | 925     | 101,212   | 素材                     |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 225     | 214   | 1,378   | 150,672   | 各種金融                   |
| CERNER CORP                  | 257     | 238   | 1,452   | 158,792   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BROADCOM LTD                 | 337     | —     | —       | —         | 半導体・半導体製造装置            |
| ALKERMES PLC                 | 124     | 123   | 579     | 63,297    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERISIGN INC                 | 77      | 67    | 853     | 93,341    | ソフトウェア・サービス            |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 257     | —     | —       | —         | 電気通信サービス               |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 147     | 211   | 1,598   | 174,779   | 商業・専門サービス              |
| EBAY INC                     | 893     | 795   | 3,041   | 332,489   | ソフトウェア・サービス            |
| IAC/INTERACTIVECORP          | —       | 58    | 864     | 94,482    | ソフトウェア・サービス            |
| NVIDIA CORP                  | 452     | 484   | 12,343  | 1,349,232 | 半導体・半導体製造装置            |
| DOLLAR TREE INC              | 198     | 189   | 1,780   | 194,609   | 小売                     |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 41      | 39    | 8,084   | 883,760   | 小売                     |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 1,026   | 1,015 | 20,245  | 2,213,034 | 各種金融                   |
| BB&T CORP                    | 681     | 630   | 3,472   | 379,545   | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 888     | 818   | 4,679   | 511,534   | 各種金融                   |
| BORGWARNER INC               | 174     | 173   | 878     | 95,983    | 自動車・自動車部品              |
| H&R BLOCK INC                | 177     | 151   | 422     | 46,227    | 消費者サービス                |
| JM SMUCKER CO/THE            | 97      | 91    | 1,031   | 112,719   | 食品・飲料・タバコ              |
| TIME WARNER INC              | 647     | 621   | 5,831   | 637,442   | メディア                   |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 137     | 130   | 1,135   | 124,104   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ASSURANT INC                 | 47      | 39    | 348     | 38,088    | 保険                     |
| AETNA INC                    | 294     | 260   | 4,553   | 497,778   | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMEREN CORPORATION           | 205     | 196   | 1,120   | 122,439   | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 415     | 395   | 2,658   | 290,589   | 公益事業                   |
| AON PLC                      | 221     | 200   | 2,884   | 315,308   | 保険                     |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 483     | 446   | 1,965   | 214,859   | 食品・飲料・タバコ              |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 76      | 60    | 347     | 38,013    | 保険                     |
| HESS CORP                    | 237     | 228   | 1,433   | 156,657   | エネルギー                  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 283     | 306   | 811     | 88,720    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 217     | 226   | 1,393   | 152,345   | 各種金融                   |
| RED HAT INC                  | 151     | 141   | 2,442   | 266,935   | ソフトウェア・サービス            |
| F5 NETWORKS INC              | 55      | 51    | 882     | 96,466    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DISH NETWORK CORP-A          | 188     | 178   | 559     | 61,104    | メディア                   |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 148     | 130   | 999     | 109,216   | ソフトウェア・サービス            |
| NETAPP INC                   | 230     | 213   | 1,544   | 168,866   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| INCYTE CORP                  | 142     | 146   | 972     | 106,274   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 369     | 321   | 675     | 73,841    | 半導体・半導体製造装置            |

| 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        |                        |
| BIOMER INC                   | 182     | 169   | 4,773   | 521,824   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ILLUMINA INC                 | 123     | 116   | 3,119   | 340,993   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADOBE SYSTEMS INC            | 417     | 394   | 9,538   | 1,042,684 | ソフトウェア・サービス            |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 208     | 202   | 3,153   | 344,698   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 768     | 730   | 1,410   | 154,228   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BED BATH & BEYOND INC        | 127     | —     | —       | —         | 小売                     |
| CELGENE CORP                 | 650     | 629   | 5,321   | 581,669   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 509     | 471   | 3,610   | 394,623   | ソフトウェア・サービス            |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 517     | 452   | 3,294   | 360,096   | ヘルスケア機器・サービス           |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 154     | 144   | 1,046   | 114,421   | 運輸                     |
| FASTENAL CO                  | 239     | 229   | 1,189   | 129,994   | 資本財                    |
| FISERV INC                   | 183     | 333   | 2,427   | 265,363   | ソフトウェア・サービス            |
| FLEX LTD                     | 442     | 440   | 651     | 71,197    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 1,401   | 1,319 | 896     | 97,953    | メディア                   |
| APPLE INC                    | 4,475   | 4,108 | 77,484  | 8,469,826 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 128     | 128   | 920     | 100,572   | 保険                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 915     | 863   | 1,305   | 142,734   | 銀行                     |
| ZIONS BANCORPORATION         | —       | 162   | 938     | 102,579   | 銀行                     |
| COSTAR GROUP INC             | 27      | 29    | 1,139   | 124,562   | 商業・専門サービス              |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 188     | 178   | 2,136   | 233,544   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 121     | 108   | 936     | 102,367   | 運輸                     |
| CENTURYLINK INC              | 454     | 769   | 1,508   | 164,923   | 電気通信サービス               |
| FLIR SYSTEMS INC             | 118     | 105   | 583     | 63,733    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MYLAN NV                     | 383     | 364   | 1,400   | 153,068   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ONEOK INC                    | 174     | 307   | 2,024   | 221,261   | エネルギー                  |
| REYNOLDS AMERICAN INC        | 717     | —     | —       | —         | 食品・飲料・タバコ              |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 244     | 231   | 1,314   | 143,698   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| BUNGE LTD                    | 114     | 116   | 827     | 90,507    | 食品・飲料・タバコ              |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 60      | 60    | 726     | 79,398    | 小売                     |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 313     | 304   | 1,235   | 135,094   | エネルギー                  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 149     | 137   | 3,034   | 331,730   | 食品・飲料・タバコ              |
| NVR INC                      | —       | 2     | 882     | 96,465    | 耐久消費財・アパレル             |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | 170     | 144   | 402     | 44,007    | エネルギー                  |
| COOPER COS INC/THE           | 40      | 39    | 933     | 102,018   | ヘルスケア機器・サービス           |
| EQT CORP                     | 147     | 204   | 1,038   | 113,552   | エネルギー                  |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 261     | 245   | 2,157   | 235,791   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WR BERKLEY CORP              | 83      | 75    | 581     | 63,531    | 保険                     |
| AGCO CORP                    | 51      | 44    | 289     | 31,597    | 資本財                    |
| DISCOVERY INC - A            | 123     | 112   | 271     | 29,674    | メディア                   |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 336     | 315   | 1,554   | 169,951   | 食品・飲料・タバコ              |
| EXPEDIA GROUP INC            | 103     | 100   | 1,146   | 125,287   | 小売                     |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 200     | 192   | 759     | 82,995    | 素材                     |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 508     | 456   | 1,321   | 144,440   | メディア                   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 133     | 118   | 1,618   | 176,875   | 各種金融                   |
| ANDEAVOR                     | 96      | 118   | 1,662   | 181,782   | エネルギー                  |
| FNF GROUP                    | 209     | 214   | 820     | 89,639    | 保険                     |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 500     | 467   | 3,338   | 364,903   | 各種金融                   |
| NASDAQ INC                   | 96      | 94    | 856     | 93,624    | 各種金融                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 145     | 109   | 205     | 22,446    | 耐久消費財・アパレル             |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | —       | 115   | 491     | 53,780    | メディア                   |
| VIACOM INC-CLASS B           | 288     | 288   | 872     | 95,334    | メディア                   |
| AUTOLIV INC                  | 72      | 70    | 1,005   | 109,917   | 自動車・自動車部品              |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     | 当 期 末   |           | 業 種 等                  |
|------------------------------|---------|-----|---------|-----------|------------------------|
|                              | 株 数     | 株 数 | 評 価 額   |           |                        |
|                              |         |     | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株  | 千アメリカドル | 千円        |                        |
| CBRE GROUP INC - A           | 251     | 244 | 1,147   | 125,468   | 不動産                    |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 24      | 20  | 862     | 94,285    | 消費者サービス                |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 173     | 204 | 1,162   | 127,110   | 食品・飲料・タバコ              |
| QURATE RETAIL INC QVC GROUP  | 341     | 354 | 780     | 85,342    | 小売                     |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 76      | 67  | 517     | 56,528    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CUMMINS INC                  | 134     | 125 | 1,840   | 201,159   | 資本財                    |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 101     | 108 | 689     | 75,391    | 資本財                    |
| LEUCADIA NATIONAL CORP       | 266     | 253 | 621     | 67,967    | 各種金融                   |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 50      | 50  | 1,088   | 119,002   | 素材                     |
| RANGE RESOURCES CORP         | 161     | 228 | 325     | 35,628    | エネルギー                  |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 432     | —   | —       | —         | エネルギー                  |
| CIMAREX ENERGY CO            | 78      | 78  | 777     | 85,018    | エネルギー                  |
| RALPH LAUREN CORP            | 48      | 41  | 454     | 49,724    | 耐久消費財・アパレル             |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 191     | 184 | 766     | 83,822    | 公益事業                   |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 89      | 77  | 870     | 95,148    | 消費者サービス                |
| HANESBRANDS INC              | 322     | 274 | 459     | 50,208    | 耐久消費財・アパレル             |
| MASTERCARD INC - A           | 807     | 751 | 14,528  | 1,588,132 | ソフトウェア・サービス            |
| WESTERN UNION CO             | 400     | 380 | 756     | 82,690    | ソフトウェア・サービス            |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | —       | 118 | 752     | 82,245    | ソフトウェア・サービス            |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 133     | 113 | 627     | 68,585    | 資本財                    |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A | —       | 93  | 783     | 85,676    | 資本財                    |
| AVNET INC                    | 104     | 90  | 369     | 40,374    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| IPG PHOTONICS CORP           | —       | 31  | 785     | 85,900    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MOSAIC CO/THE                | 284     | 267 | 710     | 77,668    | 素材                     |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 150     | 190 | 596     | 65,255    | 消費者サービス                |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 44      | 41  | 1,389   | 151,879   | 資本財                    |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 98      | 94  | 1,109   | 121,228   | ソフトウェア・サービス            |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 109     | 100 | 1,560   | 170,548   | 保険                     |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 291     | 261 | 488     | 53,357    | 銀行                     |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 299     | 281 | 2,665   | 291,350   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 332     | 290 | 2,188   | 239,259   | 各種金融                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 92      | 82  | 808     | 88,325    | 耐久消費財・アパレル             |
| WABCO HOLDINGS INC           | 44      | 39  | 514     | 56,277    | 資本財                    |
| MERCADOLIBRE INC             | 33      | 33  | 1,039   | 113,595   | ソフトウェア・サービス            |
| VMWARE INC-CLASS A           | 57      | 57  | 823     | 90,014    | ソフトウェア・サービス            |
| LOEWS CORP                   | 242     | 229 | 1,185   | 129,633   | 保険                     |
| SEATTLE GENETICS INC         | 85      | 91  | 522     | 57,148    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ULTA BEAUTY INC              | 49      | 46  | 1,158   | 126,580   | 小売                     |
| LKQ CORP                     | 253     | 256 | 778     | 85,054    | 小売                     |
| HORMEL FOODS CORP            | 238     | 237 | 861     | 94,202    | 食品・飲料・タバコ              |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | 66      | 71  | 269     | 29,423    | 運輸                     |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 121     | 115 | 1,229   | 134,399   | 素材                     |
| HARRIS CORP                  | 105     | 95  | 1,493   | 163,288   | 資本財                    |
| HUMANA INC                   | 125     | 114 | 3,252   | 355,483   | ヘルスケア機器・サービス           |
| MURPHY OIL CORP              | 130     | —   | —       | —         | エネルギー                  |
| INVESCO LTD                  | 339     | 331 | 934     | 102,130   | 各種金融                   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 144     | 140 | 1,239   | 135,519   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 115     | 112 | 724     | 79,177    | 各種金融                   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | 140     | 132 | 1,169   | 127,817   | ソフトウェア・サービス            |
| CONCHO RESOURCES INC         | 122     | 118 | 1,814   | 198,330   | エネルギー                  |
| MSCI INC                     | 75      | 72  | 1,163   | 127,128   | 各種金融                   |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 82      | 69  | 471     | 51,511    | エネルギー                  |

| 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        |                        |
| MOLSON COORS BREWING CO -B   | 158     | 153   | 934     | 102,108   | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 1,302   | 1,242 | 10,090  | 1,102,954 | 食品・飲料・タバコ              |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 1,566   | 1,450 | 19,123  | 2,090,435 | ソフトウェア・サービス            |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 154     | 144   | 1,724   | 188,558   | 食品・飲料・タバコ              |
| CORE LABORATORIES N.V.       | 37      | —     | —       | —         | エネルギー                  |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 383     | 379   | 860     | 94,027    | エネルギー                  |
| FLOWSERVE CORP               | 111     | 97    | 424     | 46,378    | 資本財                    |
| HELMERICH & PAYNE            | 92      | 85    | 589     | 64,460    | エネルギー                  |
| T-MOBILE US INC              | 243     | 233   | 1,314   | 143,725   | 電気通信サービス               |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 69      | —     | —       | —         | メディア                   |
| DISCOVERY INC-C              | 185     | 262   | 599     | 65,554    | メディア                   |
| RESMED INC                   | 115     | 113   | 1,157   | 126,546   | ヘルスケア機器・サービス           |
| GARTNER INC                  | 76      | 73    | 998     | 109,100   | ソフトウェア・サービス            |
| AMETEK INC                   | 193     | 184   | 1,381   | 151,062   | 資本財                    |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 101     | 105   | 837     | 91,592    | 保険                     |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 214     | 201   | 956     | 104,530   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 77      | 72    | 899     | 98,288    | 運輸                     |
| PERRIGO CO PLC               | 118     | 104   | 813     | 88,948    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FMC CORP                     | 110     | 107   | 956     | 104,562   | 素材                     |
| WABTEC CORP                  | 73      | 66    | 620     | 67,798    | 資本財                    |
| EVERSOURCE ENERGY            | 270     | 256   | 1,487   | 162,586   | 公益事業                   |
| INGREDION INC                | 59      | 59    | 668     | 73,127    | 食品・飲料・タバコ              |
| ALLERGAN PLC                 | 314     | 265   | 4,086   | 446,717   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CROWN HOLDINGS INC           | 114     | 105   | 469     | 51,330    | 素材                     |
| CALPINE CORP                 | 272     | —     | —       | —         | 公益事業                   |
| EATON VANCE CORP             | 96      | 86    | 494     | 54,008    | 各種金融                   |
| DELTA AIR LINES INC          | 156     | 150   | 795     | 86,951    | 運輸                     |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO    | 155     | —     | —       | —         | 食品・飲料・タバコ              |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 150     | 144   | 1,206   | 131,913   | 公益事業                   |
| VERISK ANALYTICS INC         | 131     | 125   | 1,327   | 145,100   | 商業・専門サービス              |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 237     | 218   | 2,046   | 223,675   | 小売                     |
| FORTINET INC                 | 125     | 120   | 724     | 79,228    | ソフトウェア・サービス            |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | 69      | 58    | 393     | 43,005    | 運輸                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 22      | 20    | 1,154   | 126,198   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CIT GROUP INC                | 167     | 113   | 607     | 66,380    | 銀行                     |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 1,035   | —     | —       | —         | 電気通信サービス               |
| GENERAL MOTORS CO            | 1,155   | 1,022 | 3,770   | 412,140   | 自動車・自動車部品              |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 247     | 270   | 2,681   | 293,156   | 半導体・半導体製造装置            |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 291     | 268   | 3,019   | 330,082   | 素材                     |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 38      | 37    | 824     | 90,081    | 資本財                    |
| HCA HEALTHCARE INC           | 252     | 226   | 2,305   | 252,060   | ヘルスケア機器・サービス           |
| HOLLYFRONTIER CORP           | 134     | 135   | 913     | 99,837    | エネルギー                  |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 444     | 391   | 3,025   | 330,670   | エネルギー                  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 91      | 85    | 754     | 82,478    | 公益事業                   |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 126     | 122   | 685     | 74,963    | 資本財                    |
| DEXCOM INC                   | 73      | —     | —       | —         | ヘルスケア機器・サービス           |
| MIDDLEBY CORP                | 49      | 44    | 481     | 52,637    | 資本財                    |
| XYLEM INC                    | 147     | 143   | 1,056   | 115,507   | 資本財                    |
| TRIPADVISOR INC              | 96      | 82    | 404     | 44,238    | 小売                     |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 49      | 48    | 802     | 87,724    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 130     | 126   | 1,229   | 134,358   | 銀行                     |
| ALLEGHANY CORP               | 13      | 12    | 734     | 80,297    | 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        |                        |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 65      | 63    | 1,939   | 211,979   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILLIPS 66                   | 394     | 348   | 4,099   | 448,163   | エネルギー                  |
| FACEBOOK INC-A                | 1,964   | 1,908 | 35,686  | 3,900,868 | ソフトウェア・サービス            |
| CMS ENERGY CORP               | 237     | 229   | 1,042   | 113,927   | 公益事業                   |
| ALBEMARLE CORP                | 93      | 88    | 871     | 95,230    | 素材                     |
| PVH CORP                      | 68      | 62    | 960     | 104,992   | 耐久消費財・アパレル             |
| KINDER MORGAN INC             | 1,595   | 1,609 | 2,657   | 290,455   | エネルギー                  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC          | 298     | 291   | 878     | 96,011    | 商業・専門サービス              |
| APTIV PLC                     | 228     | 212   | 2,047   | 223,797   | 自動車・自動車部品              |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING  | 145     | 140   | 733     | 80,231    | 資本財                    |
| SPLUNK INC                    | 110     | 111   | 1,299   | 142,026   | ソフトウェア・サービス            |
| OGE ENERGY CORP               | 165     | 154   | 530     | 57,943    | 公益事業                   |
| POLARIS INDUSTRIES INC        | 49      | 46    | 493     | 53,959    | 耐久消費財・アパレル             |
| ABBVIE INC                    | 1,363   | 1,277 | 13,305  | 1,454,407 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TESLA INC                     | 108     | 107   | 3,239   | 354,066   | 自動車・自動車部品              |
| CHENIERE ENERGY INC           | 166     | 164   | 1,023   | 111,893   | エネルギー                  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 105     | 105   | 991     | 108,433   | 各種金融                   |
| ZOETIS INC                    | 396     | 390   | 3,295   | 360,193   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MALLINCKRODT PLC              | 92      | —     | —       | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWS CORP - CLASS A           | 305     | 288   | 438     | 47,946    | メディア                   |
| SPRINT CORP                   | 681     | 722   | 373     | 40,777    | 電気通信サービス               |
| SNAP-ON INC                   | 47      | 47    | 702     | 76,800    | 資本財                    |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD     | 139     | 125   | 791     | 86,542    | 耐久消費財・アパレル             |
| TWITTER INC                   | 474     | 505   | 1,656   | 181,017   | ソフトウェア・サービス            |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | —       | 64    | 797     | 87,229    | ソフトウェア・サービス            |
| WORLDPAY INC-CLASS A          | 133     | 237   | 1,916   | 209,511   | ソフトウェア・サービス            |
| WORKDAY INC-CLASS A           | 101     | 109   | 1,487   | 162,606   | ソフトウェア・サービス            |
| SERVICENOW INC                | 140     | 138   | 2,471   | 270,153   | ソフトウェア・サービス            |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B   | 74      | 71    | 850     | 92,920    | ヘルスケア機器・サービス           |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC     | 78      | 71    | 1,450   | 158,595   | ソフトウェア・サービス            |
| ALLEGION PLC                  | —       | 74    | 574     | 62,790    | 資本財                    |
| ALPHABET INC-CL C             | 260     | 251   | 27,647  | 3,022,158 | ソフトウェア・サービス            |
| NAVIENT CORP                  | 257     | —     | —       | —         | 各種金融                   |
| UNITED RENTALS INC            | 69      | 67    | 1,128   | 123,357   | 資本財                    |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC   | 112     | 97    | 416     | 45,485    | 運輸                     |
| VOYA FINANCIAL INC            | 166     | 148   | 784     | 85,735    | 各種金融                   |
| ANTERO RESOURCES CORP         | 136     | 154   | 284     | 31,099    | エネルギー                  |
| IQVIA HOLDINGS INC            | 125     | 108   | 1,118   | 122,295   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLY FINANCIAL INC            | 347     | 355   | 948     | 103,653   | 各種金融                   |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  | 164     | 228   | 1,904   | 208,202   | 消費者サービス                |
| CDK GLOBAL INC                | 105     | 94    | 606     | 66,300    | ソフトウェア・サービス            |
| DIAMONDBACK ENERGY INC        | 73      | 71    | 891     | 97,436    | エネルギー                  |
| LIBERTY BROADBAND-C           | 88      | 87    | 628     | 68,722    | メディア                   |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | —       | 91    | 1,065   | 116,441   | ソフトウェア・サービス            |
| OWENS CORNING                 | —       | 85    | 569     | 62,272    | 資本財                    |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN  | 130     | 174   | 897     | 98,107    | 消費者サービス                |
| PALO ALTO NETWORKS INC        | 76      | 73    | 1,485   | 162,386   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SIGNET JEWELERS LTD           | 51      | —     | —       | —         | 小売                     |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 694     | 625   | 2,133   | 233,176   | 各種金融                   |
| QORVO INC                     | 109     | 102   | 833     | 91,132    | 半導体・半導体製造装置            |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 151     | 146   | 1,006   | 110,027   | 保険                     |
| ACUIITY BRANDS INC            | 37      | 32    | 369     | 40,420    | 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      |                        |
| JONES LANG LASALLE INC       | 36      | 36    | 615     | 67,238  | 不動産                    |
| ARAMARK                      | 190     | 202   | 770     | 84,192  | 消費者サービス                |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 430     | 392   | 1,665   | 182,015 | 銀行                     |
| LEAR CORP                    | 57      | 52    | 1,022   | 111,809 | 自動車・自動車部品              |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | —       | 70    | 714     | 78,073  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 186     | 165   | 521     | 56,991  | 素材                     |
| RITE AID CORP                | 910     | —     | —       | —       | 食品・生活必需品小売り            |
| TARGA RESOURCES CORP         | 155     | 176   | 848     | 92,770  | エネルギー                  |
| CHEMOURS CO/THE              | —       | 140   | 712     | 77,907  | 素材                     |
| LIBERTY LATIN AMERIC-CL C    | 95      | —     | —       | —       | メディア                   |
| WESTROCK CO                  | 208     | 203   | 1,242   | 135,865 | 素材                     |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 510     | 486   | 2,881   | 314,963 | 食品・飲料・タバコ              |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 911     | 913   | 7,233   | 790,745 | ソフトウェア・サービス            |
| ZILLOU GROUP INC - C         | 93      | 79    | 434     | 47,489  | ソフトウェア・サービス            |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 1,401   | 1,276 | 2,256   | 246,605 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MOBILEYE NV                  | 147     | —     | —       | —       | 自動車・自動車部品              |
| AMERCO                       | 6       | 6     | 214     | 23,417  | 運輸                     |
| CDW CORP/DE                  | 119     | 124   | 978     | 106,978 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MEDNAX INC                   | 79      | —     | —       | —       | ヘルスケア機器・サービス           |
| SABRE CORP                   | 181     | 189   | 441     | 48,246  | ソフトウェア・サービス            |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | 277     | 382   | 742     | 81,151  | ソフトウェア・サービス            |
| ARISTA NETWORKS INC          | —       | 38    | 1,002   | 109,580 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| COGNEX CORP                  | —       | 132   | 638     | 69,840  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TRANSUNION                   | —       | 146   | 1,019   | 111,486 | 商業・専門サービス              |
| WR GRACE & CO                | 60      | 60    | 437     | 47,820  | 素材                     |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | 162     | 170   | 287     | 31,480  | 耐久消費財・アパレル             |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 169     | 150   | 663     | 72,525  | メディア                   |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 79      | 69    | 306     | 33,535  | メディア                   |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | —       | 168   | 517     | 56,538  | メディア                   |
| VAIL RESORTS INC             | —       | 32    | 774     | 84,639  | 消費者サービス                |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 41      | 35    | 884     | 96,731  | 消費者サービス                |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 181     | 149   | 4,065   | 444,450 | メディア                   |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 76      | 69    | 1,475   | 161,256 | ヘルスケア機器・サービス           |
| SMITH (A.O.) CORP            | 121     | 119   | 767     | 83,894  | 資本財                    |
| UGI CORP                     | 146     | 136   | 683     | 74,668  | 公益事業                   |
| WESTAR ENERGY INC            | 119     | 113   | 608     | 66,553  | 公益事業                   |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | —       | 165   | 641     | 70,080  | 食品・飲料・タバコ              |
| FORTIVE CORP                 | 263     | 250   | 1,891   | 206,782 | 資本財                    |
| IHS MARKIT LTD               | 299     | 318   | 1,664   | 182,000 | 商業・専門サービス              |
| XL GROUP LTD                 | 222     | 204   | 1,125   | 123,060 | 保険                     |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | —       | 161   | 795     | 86,966  | ソフトウェア・サービス            |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | 187     | 162   | 1,204   | 131,664 | ソフトウェア・サービス            |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC  | 53      | —     | —       | —       | 素材                     |
| COTY INC-CL A                | 397     | 407   | 582     | 63,636  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| ARCONIC INC                  | 364     | 369   | 673     | 73,640  | 資本財                    |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 186     | 170   | 538     | 58,826  | エネルギー                  |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 53      | 53    | 804     | 87,890  | 保険                     |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | 23      | 16    | 120     | 13,133  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| TELEFLEX INC                 | 36      | 36    | 971     | 106,146 | ヘルスケア機器・サービス           |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | 135     | 141   | 481     | 52,589  | 電気通信サービス               |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | 100     | 101   | 427     | 46,759  | ヘルスケア機器・サービス           |
| TECHNIPFMC PLC               | 368     | 354   | 1,135   | 124,130 | エネルギー                  |

| 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    |                        |  |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株      | 千アメリカドル | 千円        |                        |  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | —       | 87      | 677     | 74,105    | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | —       | 83      | 896     | 97,965    | 各種金融                   |  |
| DXC TECHNOLOGY CO            | 238     | 228     | 2,385   | 260,725   | ソフトウェア・サービス            |  |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | —       | 119     | 554     | 60,652    | 保険                     |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | —       | 58      | 657     | 71,869    | 保険                     |  |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC     | —       | 165     | 493     | 53,973    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC       | —       | 133     | 533     | 58,266    | 資本財                    |  |
| ROLLINS INC                  | —       | 71      | 359     | 39,259    | 商業・専門サービス              |  |
| TESARO INC                   | —       | 33      | 169     | 18,516    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| BAKER HUGHES A GE CO         | —       | 325     | 1,163   | 127,196   | エネルギー                  |  |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC    | —       | 61      | 295     | 32,284    | 保険                     |  |
| DOWDUPONT INC                | —       | 1,872   | 12,530  | 1,369,716 | 素材                     |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | —       | 101     | 405     | 44,353    | 運輸                     |  |
| SQUARE INC - A               | —       | 215     | 1,177   | 128,750   | ソフトウェア・サービス            |  |
| VISTRA ENERGY CORP           | —       | 271     | 622     | 68,045    | 公益事業                   |  |
| BROADCOM INC                 | —       | 326     | 7,944   | 868,430   | 半導体・半導体製造装置            |  |
| APERGY CORP                  | —       | 57      | 218     | 23,844    | エネルギー                  |  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 970     | 929     | 669     | 73,216    | 不動産                    |  |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 190     | 174     | 642     | 70,221    | 資本財                    |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 210     | 177     | 1,077   | 117,828   | 資本財                    |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 261,696 | 244,756 | 1,909,323 | 208,708,204            |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 596     | 601     | —         | <61.9%>                |  |
| (カナダ)                        |         |         | 千カナダドル  |           |                        |  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 1,246   | 1,166   | 11,704  | 1,001,303 | 銀行                     |  |
| IMPERIAL OIL LTD             | 250     | 231     | 956     | 81,854    | エネルギー                  |  |
| THOMSON REUTERS CORP         | 273     | 232     | 1,116   | 95,546    | 各種金融                   |  |
| TRANSCANADA CORP             | 730     | 699     | 3,911   | 334,637   | エネルギー                  |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 308     | 291     | 1,789   | 153,104   | 電気通信サービス               |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 518     | 490     | 2,667   | 228,209   | 保険                     |  |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 466     | 457     | 1,625   | 139,026   | 素材                     |  |
| BARRICK GOLD CORP            | 985     | 944     | 1,626   | 139,148   | 素材                     |  |
| BCE INC                      | 132     | 115     | 618     | 52,910    | 電気通信サービス               |  |
| AGRIUM INC                   | 108     | —       | —       | —         | 素材                     |  |
| BOMBARDIER INC-B             | 1,707   | 1,756   | 726     | 62,193    | 資本財                    |  |
| BANK OF MONTREAL             | 542     | 518     | 5,219   | 446,561   | 銀行                     |  |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 752     | 673     | 3,490   | 298,584   | 各種金融                   |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 1,013   | 959     | 7,673   | 656,503   | 銀行                     |  |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 283     | 243     | 647     | 55,380    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CAE INC                      | 215     | 192     | 468     | 40,045    | 資本財                    |  |
| CAMECO CORP                  | 348     | 350     | 515     | 44,105    | エネルギー                  |  |
| CI FINANCIAL CORP            | 207     | 239     | 608     | 52,097    | 各種金融                   |  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 333     | 348     | 4,005   | 342,668   | 銀行                     |  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 929     | 973     | 4,479   | 383,237   | エネルギー                  |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 645     | 598     | 6,074   | 519,672   | 運輸                     |  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 56      | 52      | 844     | 72,276    | 小売                     |  |
| ENBRIDGE INC                 | 1,371   | 1,324   | 5,711   | 488,639   | エネルギー                  |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 19      | 22      | 1,566   | 134,045   | 保険                     |  |
| CGI GROUP INC - CLASS A      | 183     | 204     | 1,573   | 134,591   | ソフトウェア・サービス            |  |
| HUSKY ENERGY INC             | 281     | 257     | 470     | 40,290    | エネルギー                  |  |
| IGM FINANCIAL INC            | 86      | 78      | 304     | 26,024    | 各種金融                   |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 184     | 174     | 1,145   | 97,962    | 食品・生活必需品小売り            |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 1,661   | 1,583   | 3,929   | 336,126   | 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  |             |
| (カナダ)                        | 百株      | 百株    | 千カナダドル | 千円      |             |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 322     | 275   | 2,221  | 190,068 | 自動車・自動車部品   |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 284     | 273   | 1,729  | 147,954 | 銀行          |
| ONEX CORPORATION             | 68      | 63    | 574    | 49,126  | 各種金融        |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 700     | —     | —      | —       | 素材          |
| POWER CORP OF CANADA         | 314     | 278   | 828    | 70,896  | 保険          |
| POWER FINANCIAL CORP         | 204     | 192   | 617    | 52,841  | 保険          |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 357     | 329   | 861    | 73,686  | メディア        |
| SUNCOR ENERGY INC            | 1,402   | 1,325 | 6,746  | 577,197 | エネルギー       |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 41      | 36    | 375    | 32,103  | 食品・生活必需品小売り |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 117     | 116   | 2,766  | 236,642 | 運輸          |
| ENCANA CORP                  | 803     | 788   | 1,331  | 113,928 | エネルギー       |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 185     | 189   | 1,079  | 92,389  | 素材          |
| FINNING INTERNATIONAL INC    | 133     | 150   | 499    | 42,706  | 資本財         |
| GOLDCORP INC                 | 729     | 704   | 1,242  | 106,301 | 素材          |
| KINROSS GOLD CORP            | 995     | 901   | 429    | 36,767  | 素材          |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 126     | 134   | 751    | 64,299  | 資本財         |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 246     | 238   | 794    | 67,985  | 保険          |
| METHANEX CORP                | 71      | 65    | 577    | 49,390  | 素材          |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 869     | 670   | 251    | 21,494  | 素材          |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A | 71      | 73    | 178    | 15,288  | 食品・生活必需品小売り |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 179     | 170   | 624    | 53,447  | 耐久消費財・アパレル  |
| SAPUTO INC                   | 208     | 160   | 684    | 58,543  | 食品・飲料・タバコ   |
| BLACKBERRY LTD               | 404     | 389   | 576    | 49,352  | ソフトウェア・サービス |
| TELUS CORP                   | 116     | 116   | 530    | 45,351  | 電気通信サービス    |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 586     | 566   | 1,178  | 100,861 | 素材          |
| YAMANA GOLD INC              | 824     | —     | —      | —       | 素材          |
| FORTIS INC                   | 344     | 342   | 1,443  | 123,498 | 公益事業        |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  | 354     | 345   | 1,849  | 158,199 | 食品・生活必需品小売り |
| ELDORADO GOLD CORP           | 624     | —     | —      | —       | 素材          |
| LUNDIN MINING CORP           | —       | 484   | 413    | 35,402  | 素材          |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 1,559   | 1,478 | 11,036 | 944,149 | 銀行          |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 148     | 151   | 1,416  | 121,222 | 素材          |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 375     | 351   | 981    | 83,988  | 素材          |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 144     | 116   | 285    | 24,432  | 食品・生活必需品小売り |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 82      | 76    | 395    | 33,854  | 保険          |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 104     | 123   | 390    | 33,419  | 公益事業        |
| METRO INC                    | 199     | 174   | 712    | 60,912  | 食品・生活必需品小売り |
| OPEN TEXT CORP               | 215     | 215   | 957    | 81,886  | ソフトウェア・サービス |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 109     | 106   | 1,011  | 86,556  | 保険          |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP   | 459     | 483   | 505    | 43,262  | エネルギー       |
| CENOVUS ENERGY INC           | 874     | 814   | 1,138  | 97,423  | エネルギー       |
| ARC RESOURCES LTD            | 305     | 244   | 325    | 27,825  | エネルギー       |
| TOURMALINE OIL CORP          | 197     | 205   | 479    | 41,055  | エネルギー       |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 336     | 404   | 1,791  | 153,266 | エネルギー       |
| VERMILION ENERGY INC         | 94      | 101   | 445    | 38,104  | エネルギー       |
| DOLLARAMA INC                | 95      | 86    | 1,264  | 108,144 | 小売          |
| KEYERA CORP                  | 160     | 173   | 622    | 53,236  | エネルギー       |
| ALTAGAS LTD                  | 148     | 155   | 394    | 33,787  | エネルギー       |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 142     | —     | —      | —       | エネルギー       |
| ATCO LTD -CLASS I            | 63      | 76    | 292    | 25,044  | 公益事業        |
| FIRST CAPITAL REALTY INC     | 115     | 138   | 285    | 24,450  | 不動産         |
| INTER PIPELINE LTD           | 296     | 300   | 709    | 60,723  | エネルギー       |

| 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    |                        |  |
| (カナダ)                        | 百株           | 百株     | 千カナダドル | 千円        |                        |  |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | 162          | 151    | 408    | 34,913    | エネルギー                  |  |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 211          | 228    | 370    | 31,696    | エネルギー                  |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 16           | 16     | 1,553  | 132,887   | ソフトウェア・サービス            |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 185          | 183    | 1,332  | 114,004   | 消費者サービス                |  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 56           | 49     | 442    | 37,819    | 素材                     |  |
| VERESEN INC                  | 255          | —      | —      | —         | エネルギー                  |  |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 24           | 106    | 665    | 56,976    | 素材                     |  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 306          | 352    | 163    | 13,972    | 各種金融                   |  |
| LINAMAR CORP                 | 43           | 44     | 327    | 27,979    | 自動車・自動車部品              |  |
| HYDRO ONE LTD                | 168          | 225    | 443    | 37,977    | 公益事業                   |  |
| EMERA INC                    | 50           | 54     | 217    | 18,585    | 公益事業                   |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | —            | 71     | 1,310  | 112,084   | ソフトウェア・サービス            |  |
| NUTRIEN LTD                  | —            | 515    | 3,222  | 275,723   | 素材                     |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 35,203 | 32,504 | 142,534   | 12,193,842             |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 91     | 88     | —         | < 3.6% >               |  |
| (ユーロ…ドイツ)                    |              |        |        | 千ユーロ      |                        |  |
| COMMERZBANK AG               | 881          | 855    | 923    | 120,740   | 銀行                     |  |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 1,738        | 1,653  | 1,924  | 251,596   | 各種金融                   |  |
| CECONOMY AG                  | 152          | —      | —      | —         | 小売                     |  |
| SIEMENS AG-REG               | 641          | 611    | 7,066  | 923,695   | 資本財                    |  |
| RWE AG                       | 403          | 418    | 840    | 109,907   | 公益事業                   |  |
| BASF SE                      | 770          | 735    | 6,386  | 834,757   | 素材                     |  |
| VOLKSWAGEN AG                | 26           | 27     | 464    | 60,758    | 自動車・自動車部品              |  |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 808          | 770    | 5,164  | 675,099   | 自動車・自動車部品              |  |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 149          | 140    | 1,462  | 191,162   | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| E.ON SE                      | 1,861        | 1,767  | 1,651  | 215,813   | 公益事業                   |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 277          | 266    | 2,460  | 321,656   | 自動車・自動車部品              |  |
| BAYER AG-REG                 | 694          | 661    | 6,755  | 882,977   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| LINDE AG                     | 155          | —      | —      | —         | 素材                     |  |
| ALLIANZ SE-REG               | 382          | 356    | 6,837  | 893,742   | 保険                     |  |
| MAN SE                       | 29           | 25     | 243    | 31,833    | 資本財                    |  |
| CONTINENTAL AG               | 92           | 88     | 1,961  | 256,334   | 自動車・自動車部品              |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 953          | 910    | 2,180  | 285,076   | 半導体・半導体製造装置            |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 130          | 122    | 855    | 111,881   | 自動車・自動車部品              |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 210          | 194    | 489    | 63,952    | 運輸                     |  |
| HUGO BOSS AG -ORD            | 53           | 46     | 346    | 45,233    | 耐久消費財・アパレル             |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 814          | 778    | 2,679  | 350,252   | 運輸                     |  |
| SAP SE                       | 824          | 786    | 7,660  | 1,001,243 | ソフトウェア・サービス            |  |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE      | 193          | 185    | 539    | 70,517    | メディア                   |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 162          | 154    | 1,803  | 235,687   | 各種金融                   |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 180          | 172    | 1,463  | 191,296   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 33           | 29     | 247    | 32,303    | 運輸                     |  |
| ADIDAS AG                    | 158          | 150    | 2,858  | 373,697   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 2,748        | 2,669  | 3,809  | 497,979   | 電気通信サービス               |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 134          | 124    | 2,388  | 312,256   | 保険                     |  |
| THYSSENKRUPP AG              | 302          | 352    | 817    | 106,877   | 素材                     |  |
| BEIERSDORF AG                | 82           | 82     | 801    | 104,759   | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| HEIDELBERGCEMENT AG          | 123          | 119    | 954    | 124,718   | 素材                     |  |
| MERCK KGAA                   | 109          | 104    | 872    | 114,026   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 156          | 147    | 2,540  | 332,099   | 自動車・自動車部品              |  |
| LANXESS AG                   | 74           | 71     | 491    | 64,284    | 素材                     |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 344          | 332    | 2,215  | 289,563   | ヘルスケア機器・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…ドイツ)                    | 百株               | 百株           | 千ユーロ         | 千円          |                        |  |
| HOCHTIEF AG                  | 16               | 17           | 269          | 35,232      | 資本財                    |  |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           | 294              | 284          | 1,130        | 147,744     | 不動産                    |  |
| GEA GROUP AG                 | 156              | 145          | 479          | 62,718      | 資本財                    |  |
| SYMRIS AG                    | 100              | 101          | 721          | 94,341      | 素材                     |  |
| K+S AG-REG                   | 166              | 141          | 343          | 44,850      | 素材                     |  |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 86               | 86           | 838          | 109,551     | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 105              | 99           | 564          | 73,803      | ソフトウェア・サービス            |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 46               | 40           | 331          | 43,383      | 自動車・自動車部品              |  |
| HANNOVER RUECK SE            | 50               | 48           | 552          | 72,223      | 保険                     |  |
| BRENNTAG AG                  | 127              | 130          | 650          | 85,076      | 資本財                    |  |
| AXEL SPRINGER SE             | 37               | 33           | 224          | 29,357      | メディア                   |  |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF      | 59               | 63           | 288          | 37,654      | 素材                     |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 647              | 679          | 281          | 36,738      | 電気通信サービス               |  |
| OSRAM LICHT AG               | 75               | 83           | 424          | 55,504      | 資本財                    |  |
| VONOVIA SE                   | 391              | 389          | 1,537        | 200,916     | 不動産                    |  |
| EVONIK INDUSTRIES AG         | 130              | 122          | 384          | 50,301      | 素材                     |  |
| ZALANDO SE                   | 75               | 85           | 371          | 48,527      | 小売                     |  |
| COVESTRO AG                  | 74               | 154          | 1,200        | 156,968     | 素材                     |  |
| SCHAEFFLER AG                | 146              | 161          | 218          | 28,510      | 自動車・自動車部品              |  |
| UNIPER SE                    | —                | 162          | 441          | 57,674      | 公益事業                   |  |
| INNOGY SE                    | 122              | 108          | 395          | 51,713      | 公益事業                   |  |
| METRO AG                     | —                | 118          | 138          | 18,106      | 食品・生活必需品小売り            |  |
| KION GROUP AG                | —                | 53           | 387          | 50,607      | 資本財                    |  |
| LINDE AG - TENDER            | —                | 148          | 2,885        | 377,225     | 素材                     |  |
| I&I DRILLISCH AG             | —                | 39           | 247          | 32,361      | 電気通信サービス               |  |
| MTU AERO ENGINES AG          | —                | 39           | 606          | 79,312      | 資本財                    |  |
| WIRECARD AG                  | —                | 94           | 1,146        | 149,900     | ソフトウェア・サービス            |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | —                | 127          | 429          | 56,132      | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,768<br>56 | 19,677<br>62 | 97,653<br>— | 12,764,225<br><3.8%>   |  |
| (ユーロ…イタリア)                   |                  |              |              |             |                        |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 984              | 1,000        | 1,650        | 215,749     | 保険                     |  |
| INTESA SANPAOLO              | 10,651           | 10,692       | 3,363        | 439,672     | 銀行                     |  |
| TELECOM ITALIA SPA           | 9,443            | 9,443        | 759          | 99,295      | 電気通信サービス               |  |
| ENI SPA                      | 2,143            | 2,038        | 3,351        | 438,011     | エネルギー                  |  |
| UNICREDIT SPA                | 1,589            | 1,602        | 2,875        | 375,797     | 銀行                     |  |
| ENEL SPA                     | 6,437            | 6,530        | 3,311        | 432,808     | 公益事業                   |  |
| SAIPEM SPA                   | 5,277            | —            | —            | —           | エネルギー                  |  |
| RECORDATI SPA                | —                | 72           | 221          | 28,931      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ATLANTIA SPA                 | 342              | 364          | 1,027        | 134,348     | 運輸                     |  |
| INTESA SANPAOLO-RSP          | 800              | 843          | 278          | 36,349      | 銀行                     |  |
| LUXOTTICA GROUP SPA          | 138              | 139          | 731          | 95,646      | 耐久消費財・アパレル             |  |
| MEDIOBANCA SPA               | 484              | 524          | 522          | 68,247      | 銀行                     |  |
| SNAM SPA                     | 2,037            | 1,864        | 721          | 94,335      | エネルギー                  |  |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 5,183            | 4,414        | 310          | 40,624      | 電気通信サービス               |  |
| LEONARDO SPA                 | 343              | 332          | 319          | 41,801      | 資本財                    |  |
| TERNA SPA                    | 1,253            | 1,155        | 563          | 73,667      | 公益事業                   |  |
| UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA  | 975              | 880          | 192          | 25,104      | 保険                     |  |
| PRYSMIAN SPA                 | 158              | 158          | 423          | 55,306      | 資本財                    |  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA    | —                | 426          | 266          | 34,791      | 食品・飲料・タバコ              |  |

| 銘柄                           | 株数        | 当 期 末  |        |           | 業 種 等                  |  |
|------------------------------|-----------|--------|--------|-----------|------------------------|--|
|                              |           | 株 数    | 評 価 額  |           |                        |  |
|                              |           |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |  |
| (ユーロ…イタリア)                   | 百株        | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                        |  |
| POSTE ITALIANE SPA           | 442       | 373    | 304    | 39,778    | 保険                     |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額 | 48,688 | 42,860 | 21,193    | 2,770,266              |  |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |           | 18     | 19     | —         | < 0.8% >               |  |
| (ユーロ…フランス)                   |           |        |        |           |                        |  |
| MICHELIN (CGDE)              | 153       | 137    | 1,632  | 213,322   | 自動車・自動車部品              |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 234       | 223    | 6,555  | 856,907   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| PEUGEOT SA                   | 400       | 471    | 947    | 123,802   | 自動車・自動車部品              |  |
| AXA SA                       | 1,624     | 1,551  | 3,491  | 456,317   | 保険                     |  |
| DANONE                       | 495       | 482    | 3,126  | 408,625   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CARREFOUR SA                 | 476       | 474    | 780    | 102,056   | 食品・生活必需品小売り            |  |
| VIVENDI                      | 865       | 826    | 1,920  | 251,029   | メディア                   |  |
| INGENICO GROUP               | 44        | 43     | 322    | 42,157    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| SOCIETE GENERALE SA          | 643       | 613    | 2,620  | 342,470   | 銀行                     |  |
| AIR LIQUIDE SA               | 326       | 343    | 3,709  | 484,890   | 素材                     |  |
| TOTAL SA                     | 1,909     | 1,922  | 10,255 | 1,340,450 | エネルギー                  |  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 420       | 399    | 1,805  | 235,991   | 資本財                    |  |
| ZODIAC AEROSPACE             | 172       | —      | —      | —         | 資本財                    |  |
| VINCI SA                     | 426       | 405    | 3,470  | 453,655   | 資本財                    |  |
| SANOFI                       | 973       | 909    | 5,795  | 757,520   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 399       | 392    | 811    | 106,133   | 公益事業                   |  |
| L'OREAL                      | 210       | 201    | 4,032  | 527,132   | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| ACCOR SA                     | 145       | 154    | 715    | 93,585    | 消費者サービス                |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 471       | 453    | 3,428  | 448,123   | 資本財                    |  |
| BNP PARIBAS                  | 942       | 898    | 5,639  | 737,148   | 銀行                     |  |
| ESSILOR INTERNATIONAL        | 173       | 166    | 1,905  | 249,087   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| CAPGEMINI SE                 | 137       | 128    | 1,489  | 194,735   | ソフトウェア・サービス            |  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON    | 43        | 52     | 214    | 28,071    | 食品・生活必需品小売り            |  |
| VALEO SA                     | 201       | 191    | 1,097  | 143,396   | 自動車・自動車部品              |  |
| HERMES INTERNATIONAL         | 21        | 25     | 1,489  | 194,729   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| SODEXO SA                    | 77        | 75     | 634    | 82,882    | 消費者サービス                |  |
| KERING                       | 63        | 60     | 2,997  | 391,835   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 108       | 104    | 1,155  | 151,100   | ソフトウェア・サービス            |  |
| CHRISTIAN DIOR SE            | 45        | —      | —      | —         | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ATOS SE                      | 74        | 76     | 848    | 110,858   | ソフトウェア・サービス            |  |
| ORANGE                       | 1,675     | 1,599  | 2,429  | 317,532   | 電気通信サービス               |  |
| CNP ASSURANCES               | 138       | 126    | 263    | 34,483    | 保険                     |  |
| IMERYS SA                    | 31        | 32     | 238    | 31,223    | 素材                     |  |
| SAFRAN SA                    | 262       | 266    | 2,653  | 346,776   | 資本財                    |  |
| RENAULT SA                   | 161       | 153    | 1,366  | 178,615   | 自動車・自動車部品              |  |
| PUBLICIS GROUPE              | 159       | 165    | 1,029  | 134,548   | メディア                   |  |
| LAGARDERE SCA                | 102       | 110    | 256    | 33,530    | メディア                   |  |
| JCDECAUX SA                  | 64        | 67     | 198    | 25,976    | メディア                   |  |
| SOCIETE BIC SA               | 24        | 26     | 224    | 29,352    | 商業・専門サービス              |  |
| BOUYGUES SA                  | 170       | 176    | 759    | 99,321    | 資本財                    |  |
| THALES SA                    | 89        | 84     | 938    | 122,661   | 資本財                    |  |
| PERNOD RICARD SA             | 178       | 170    | 2,352  | 307,531   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 945       | 910    | 1,226  | 160,350   | 銀行                     |  |
| ENGIE                        | 1,332     | 1,467  | 2,148  | 280,885   | 公益事業                   |  |
| ALSTOM                       | 123       | 117    | 453    | 59,257    | 資本財                    |  |
| ARKEMA                       | 55        | 55     | 607    | 79,433    | 素材                     |  |
| LEGRAND SA                   | 224       | 213    | 1,416  | 185,145   | 資本財                    |  |
| SCOR SE                      | 138       | 132    | 439    | 57,503    | 保険                     |  |

| 銘柄                           | 株数           | 当 期    |        | 期 末     |            | 業 種 等                  |
|------------------------------|--------------|--------|--------|---------|------------|------------------------|
|                              |              | 株 数    | 株 数    | 評 価 額   |            |                        |
|                              |              |        |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |
| (ユーロ…フランス)                   | 百株           | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |            |                        |
| ADP                          | 26           | 23     | 429    | 56,130  |            | 運輸                     |
| EDF                          | 316          | 447    | 549    | 71,878  |            | 公益事業                   |
| NATIXIS                      | 808          | 739    | 513    | 67,069  |            | 各種金融                   |
| WENDEL                       | 23           | 20     | 261    | 34,177  |            | 各種金融                   |
| BUREAU VERITAS SA            | 228          | 209    | 455    | 59,474  |            | 商業・専門サービス              |
| EURAZEO SA                   | 34           | 32     | 227    | 29,685  |            | 各種金融                   |
| SUEZ                         | 282          | 276    | 327    | 42,768  |            | 公益事業                   |
| EIFFAGE                      | 47           | 60     | 608    | 79,579  |            | 資本財                    |
| ILIAD SA                     | 22           | 19     | 326    | 42,655  |            | 電気通信サービス               |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 152          | 158    | 283    | 37,111  |            | メディア                   |
| BIOMERIEUX                   | —            | 29     | 201    | 26,310  |            | ヘルスケア機器・サービス           |
| GETLINK SE                   | 403          | 368    | 435    | 56,941  |            | 運輸                     |
| EDENRED                      | 180          | 177    | 505    | 66,092  |            | 商業・専門サービス              |
| REMY COINTREAU               | 19           | 20     | 242    | 31,746  |            | 食品・飲料・タバコ              |
| REXEL SA                     | 258          | 221    | 289    | 37,877  |            | 資本財                    |
| BOLLORE                      | 764          | 633    | 279    | 36,555  |            | 運輸                     |
| SPR GROUP SA                 | 78           | —      | —      | —       |            | 電気通信サービス               |
| DASSAULT AVIATION SA         | 2            | 1      | 307    | 40,219  |            | 資本財                    |
| SEB SA                       | 18           | 16     | 261    | 34,217  |            | 耐久消費財・アパレル             |
| IPSEN                        | —            | 28     | 365    | 47,711  |            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMUNDI SA                    | —            | 46     | 330    | 43,251  |            | 各種金融                   |
| FAURECIA                     | —            | 62     | 440    | 57,547  |            | 自動車・自動車部品              |
| TELEPERFORMANCE              | —            | 44     | 598    | 78,198  |            | 商業・専門サービス              |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | —            | 59     | 514    | 67,256  |            | ソフトウェア・サービス            |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 21,831 | 21,359 | 100,654 | 13,156,606 |                        |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 66     | 69     | —       | < 3.9% >   |                        |
| (ユーロ…オランダ)                   |              |        |        |         |            |                        |
| QIAGEN N.V.                  | 188          | 165    | 486    | 63,553  |            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 852          | 824    | 866    | 113,264 |            | 資本財                    |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 745          | 860    | 1,635  | 213,822 |            | 自動車・自動車部品              |
| FERRARI NV                   | 106          | 98     | 1,121  | 146,620 |            | 自動車・自動車部品              |
| EXOR NV                      | 88           | 86     | 563    | 73,647  |            | 各種金融                   |
| AIRBUS SE                    | 486          | 464    | 4,622  | 604,211 |            | 資本財                    |
| STMICROELECTRONICS NV        | 530          | 510    | 1,030  | 134,739 |            | 半導体・半導体製造装置            |
| GEMALTO                      | 69           | —      | —      | —       |            | ソフトウェア・サービス            |
| WOLTERS KLUWER               | 251          | 232    | 1,077  | 140,894 |            | 商業・専門サービス              |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 2,842        | 2,775  | 703    | 92,000  |            | 電気通信サービス               |
| AKZO NOBEL                   | 212          | 201    | 1,514  | 197,952 |            | 素材                     |
| HEINEKEN NV                  | 193          | 206    | 1,809  | 236,483 |            | 食品・飲料・タバコ              |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 797          | 751    | 2,640  | 345,118 |            | ヘルスケア機器・サービス           |
| RELX NV                      | 839          | 772    | 1,385  | 181,041 |            | 商業・専門サービス              |
| AEGON NV                     | 1,450        | 1,435  | 835    | 109,206 |            | 保険                     |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 1,074        | 1,023  | 2,008  | 262,470 |            | 食品・生活必需品小売り            |
| RANDSTAD NV                  | 101          | 97     | 522    | 68,338  |            | 商業・専門サービス              |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 85           | 94     | 797    | 104,295 |            | 食品・飲料・タバコ              |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 150          | 145    | 1,241  | 162,222 |            | 素材                     |
| ING GROEP NV                 | 3,254        | 3,104  | 4,156  | 543,316 |            | 銀行                     |
| ASML HOLDING NV              | 313          | 310    | 5,196  | 679,207 |            | 半導体・半導体製造装置            |
| UNILEVER NV-CVA              | 1,367        | 1,302  | 6,189  | 809,069 |            | 家庭用品・パーソナル用品           |
| VOPAK                        | 62           | 48     | 199    | 26,116  |            | エネルギー                  |
| BOSKALIS WESTMINSTER         | 78           | 82     | 195    | 25,601  |            | 資本財                    |
| NN GROUP NV                  | 263          | 244    | 954    | 124,775 |            | 保険                     |



| 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    |                        |
| <b>(ユーロ…オランダ)</b>            |         |        |        |           |                        |
| ALTICE NV - B                | 94      | —      | —      | —         | メディア                   |
| ALTICE NV - A                | 306     | 479    | 370    | 48,377    | メディア                   |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        | 233     | 340    | 898    | 117,409   | 銀行                     |
| 株数・金額                        | 17,040  | 16,659 | 43,024 | 5,623,756 |                        |
| 小計                           | 銘柄数<比率> | 28     | 26     | —         | <1.7%>                 |
| <b>(ユーロ…スペイン)</b>            |         |        |        |           |                        |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | —       | 216    | 299    | 39,138    | 資本財                    |
| BANCO POPULAR ESPANOL        | 2,911   | —      | —      | —         | 銀行                     |
| ENDESA SA                    | 264     | 243    | 474    | 62,018    | 公益事業                   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 195     | 195    | 715    | 93,568    | 資本財                    |
| IBERDROLA SA                 | 4,655   | 4,657  | 3,033  | 396,464   | 公益事業                   |
| TELEFONICA SA                | 3,808   | 3,732  | 3,116  | 407,307   | 電気通信サービス               |
| BANCO SANTANDER SA           | 12,241  | 12,896 | 7,116  | 930,198   | 銀行                     |
| BANKINTER SA                 | 547     | 515    | 469    | 61,396    | 銀行                     |
| REPSOL SA                    | 952     | 1,001  | 1,666  | 217,855   | エネルギー                  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 5,614   | 5,322  | 3,647  | 476,809   | 銀行                     |
| GAS NATURAL SDG SA           | 288     | 277    | 604    | 79,051    | 公益事業                   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 914     | 871    | 2,330  | 304,656   | 小売                     |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA  | 542     | 558    | 1,019  | 133,289   | 運輸                     |
| MAPPRE SA                    | 927     | 969    | 283    | 37,028    | 保険                     |
| FERROVIAL SA                 | 414     | 392    | 704    | 92,122    | 資本財                    |
| FERROVIAL SA-RTS             | 414     | —      | —      | —         | 資本財                    |
| ZARDOYA OTIS SA              | 156     | —      | —      | —         | 資本財                    |
| ENAGAS SA                    | 185     | 172    | 425    | 55,643    | エネルギー                  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 371     | 363    | 627    | 81,991    | 公益事業                   |
| BANCO DE SABADELL SA         | 4,410   | 4,391  | 760    | 99,447    | 銀行                     |
| CAIXABANK S.A                | 3,009   | 2,858  | 1,229  | 160,715   | 銀行                     |
| GRIFOLS SA                   | 254     | 241    | 603    | 78,910    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 369     | 350    | 2,253  | 294,526   | ソフトウェア・サービス            |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 705     | 483    | 382    | 50,052    | 運輸                     |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL  | 543     | —      | —      | —         | 食品・生活必需品小売り            |
| BANKIA SA                    | 3,727   | 911    | 341    | 44,634    | 銀行                     |
| AENA SME SA                  | 56      | 54     | 962    | 125,749   | 運輸                     |
| 株数・金額                        | 48,483  | 41,679 | 33,069 | 4,322,576 |                        |
| 小計                           | 銘柄数<比率> | 26     | 23     | —         | <1.3%>                 |
| <b>(ユーロ…ベルギー)</b>            |         |        |        |           |                        |
| AGEAS                        | 158     | 155    | 692    | 90,470    | 保険                     |
| UCB SA                       | 104     | 105    | 661    | 86,464    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 67      | 67     | 624    | 81,656    | 各種金融                   |
| UMICORE                      | 77      | 170    | 819    | 107,145   | 素材                     |
| COLRUYT SA                   | 57      | 53     | 251    | 32,891    | 食品・生活必需品小売り            |
| KBC GROUP NV                 | 211     | 200    | 1,446  | 189,027   | 銀行                     |
| SOLVAY SA                    | 61      | 57     | 671    | 87,805    | 素材                     |
| PROXIMUS                     | 131     | 107    | 260    | 34,087    | 電気通信サービス               |
| TELENET GROUP HOLDING NV     | 42      | 35     | 176    | 23,064    | メディア                   |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 640     | 609    | 4,864  | 635,832   | 食品・飲料・タバコ              |
| 株数・金額                        | 1,554   | 1,562  | 10,469 | 1,368,444 |                        |
| 小計                           | 銘柄数<比率> | 10     | 10     | —         | <0.4%>                 |
| <b>(ユーロ…オーストリア)</b>          |         |        |        |           |                        |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 250     | 244    | 947    | 123,782   | 銀行                     |
| OMV AG                       | 127     | 120    | 663    | 86,731    | エネルギー                  |
| VOESTALPINE AG               | 97      | 89     | 417    | 54,577    | 素材                     |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当 期 末        |         |          | 業 種 等     |            |
|------------------------------|---------|--------------|---------|----------|-----------|------------|
|                              |         | 株 数          | 株 数     | 評 価 額    |           |            |
|                              |         |              |         | 外貨建金額    |           | 邦貨換算金額     |
| (ユーロ…オーストリア)                 |         | 百株           | 百株      | 千ユーロ     | 千円        |            |
| ANDRITZ AG                   |         | 62           | 51      | 226      | 29,574    |            |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA |         | 105          | 111     | 317      | 41,461    |            |
| 小 計                          |         | 株 数 ・ 金 額    | 645     | 617      | 2,571     | 336,128    |
|                              |         | 銘柄 数 < 比 率 > | 5       | 5        | —         | < 0.1% >   |
| (ユーロ…ルクセンブルク)                |         |              |         |          |           |            |
| RTL GROUP                    |         | 32           | 25      | 181      | 23,683    |            |
| TENARIS SA                   |         | 402          | 380     | 620      | 81,128    |            |
| SES                          |         | 310          | 317     | 421      | 55,152    |            |
| EUROFINS SCIENTIFIC          |         | 9            | 10      | 446      | 58,419    |            |
| ARCELORMITTAL                |         | 1,532        | 533     | 1,612    | 210,750   |            |
| 小 計                          |         | 株 数 ・ 金 額    | 2,287   | 1,266    | 3,283     | 429,134    |
|                              |         | 銘柄 数 < 比 率 > | 5       | 5        | —         | < 0.1% >   |
| (ユーロ…フィンランド)                 |         |              |         |          |           |            |
| NOKIA OYJ                    |         | 4,900        | 4,662   | 2,492    | 325,828   |            |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |         | 472          | 450     | 778      | 101,698   |            |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           |         | 92           | 84      | 271      | 35,540    |            |
| UPM-KYMMENE OYJ              |         | 445          | 426     | 1,322    | 172,824   |            |
| FORTUM OYJ                   |         | 385          | 367     | 737      | 96,452    |            |
| KONE OYJ-B                   |         | 281          | 269     | 1,126    | 147,217   |            |
| METSO OYJ                    |         | 90           | 102     | 311      | 40,725    |            |
| SAMPO OYJ-A SHS              |         | 373          | 357     | 1,571    | 205,382   |            |
| WARTSILA OYJ ABP             |         | 121          | 368     | 662      | 86,603    |            |
| ELISA OYJ                    |         | 122          | 110     | 410      | 53,641    |            |
| NESTE OYJ                    |         | 110          | 104     | 705      | 92,210    |            |
| ORION OYJ-CLASS B            |         | 88           | 69      | 174      | 22,832    |            |
| 小 計                          |         | 株 数 ・ 金 額    | 7,483   | 7,372    | 10,565    | 1,380,957  |
|                              |         | 銘柄 数 < 比 率 > | 12      | 12       | —         | < 0.4% >   |
| (ユーロ…アイルランド)                 |         |              |         |          |           |            |
| KERRY GROUP PLC-A            |         | 135          | 128     | 1,145    | 149,719   |            |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      |         | 70           | 68      | 553      | 72,407    |            |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC    |         | —            | 761     | 570      | 74,635    |            |
| AIB GROUP PLC                |         | —            | 667     | 334      | 43,688    |            |
| IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD |         | 472          | 472     | —        | —         |            |
| BANK OF IRELAND              |         | 24,069       | —       | —        | —         |            |
| CRH PLC                      |         | 711          | 676     | 2,078    | 271,646   |            |
| 小 計                          |         | 株 数 ・ 金 額    | 25,459  | 2,775    | 4,682     | 612,097    |
|                              |         | 銘柄 数 < 比 率 > | 5       | 6        | —         | < 0.2% >   |
| (ユーロ…ポルトガル)                  |         |              |         |          |           |            |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  |         | 2,063        | 1,874   | 582      | 76,184    |            |
| JERONIMO MARTINS             |         | 200          | 183     | 249      | 32,669    |            |
| GALP ENERGIA SGPS SA         |         | 432          | 412     | 705      | 92,193    |            |
| 小 計                          |         | 株 数 ・ 金 額    | 2,696   | 2,469    | 1,538     | 201,047    |
|                              |         | 銘柄 数 < 比 率 > | 3       | 3        | —         | < 0.1% >   |
| (ユーロ…イギリス)                   |         |              |         |          |           |            |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  |         | 183          | —       | —        | —         |            |
| 小 計                          |         | 株 数 ・ 金 額    | 183     | —        | —         | —          |
|                              |         | 銘柄 数 < 比 率 > | 1       | —        | —         | < -% >     |
| ユ ー ロ 計                      |         | 株 数 ・ 金 額    | 196,121 | 158,300  | 328,706   | 42,965,241 |
|                              |         | 銘柄 数 < 比 率 > | 235     | 240      | —         | < 12.7% >  |
| (イギリス)                       |         |              |         | 千イギリスポンド |           |            |
| BARCLAYS PLC                 |         | 14,226       | 13,647  | 2,926    | 433,953   |            |
| BP PLC                       |         | 15,886       | 15,849  | 8,946    | 1,326,555 |            |

| 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        |                        |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 53,905  | 57,648 | 3,867    | 573,372   | 銀行                     |
| ASTRAZENECA PLC              | 1,062   | 1,013  | 5,351    | 793,487   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SMITHS GROUP PLC             | 324     | 328    | 547      | 81,244    | 資本財                    |
| NEXT PLC                     | 118     | 120    | 667      | 98,967    | 小売                     |
| DIAGEO PLC                   | 2,111   | 1,998  | 5,356    | 794,211   | 食品・飲料・タバコ              |
| SKY PLC                      | 857     | 825    | 1,120    | 166,162   | メディア                   |
| BAE SYSTEMS PLC              | 2,673   | 2,553  | 1,620    | 240,231   | 資本財                    |
| UNILEVER PLC                 | 1,077   | 986    | 4,082    | 605,361   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| TESCO PLC                    | 6,877   | 7,792  | 1,921    | 284,928   | 食品・生活必需品小売り            |
| RELX PLC                     | 916     | 856    | 1,364    | 202,246   | 商業・専門サービス              |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 1,377   | 1,211  | 355      | 52,675    | 小売                     |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 528     | 534    | 3,079    | 456,548   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PRUDENTIAL PLC               | 2,164   | 2,072  | 3,998    | 592,790   | 保険                     |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 5,006   | 4,789  | 1,338    | 198,497   | 保険                     |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 895     | 893    | 606      | 89,994    | ソフトウェア・サービス            |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 16,605  | 16,007 | 11,778   | 1,746,359 | 銀行                     |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,564   | 1,835  | 7,085    | 1,050,531 | 食品・飲料・タバコ              |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 578     | 528    | 404      | 60,045    | 公益事業                   |
| SCHRODERS PLC                | 108     | 92     | 319      | 47,394    | 各種金融                   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 2,948   | 2,880  | 847      | 125,588   | 銀行                     |
| BHP BILLITON PLC             | 1,772   | 1,695  | 2,901    | 430,250   | 素材                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 805     | 763    | 2,112    | 313,201   | 食品・飲料・タバコ              |
| WPP PLC                      | 1,076   | 1,008  | 1,322    | 196,041   | メディア                   |
| CENTRICA PLC                 | 4,608   | 4,515  | 664      | 98,527    | 公益事業                   |
| BT GROUP PLC                 | 7,104   | 6,753  | 1,465    | 217,296   | 電気通信サービス               |
| SSE PLC                      | 861     | 824    | 1,160    | 172,042   | 公益事業                   |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 2,758   | 2,639  | 2,029    | 300,954   | 銀行                     |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 1,546   | 1,327  | 1,110    | 164,600   | 資本財                    |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C   | 114,200 | 86,184 | 8        | 1,277     | 資本財                    |
| COMPASS GROUP PLC            | 1,380   | 1,269  | 1,913    | 283,743   | 消費者サービス                |
| KINGFISHER PLC               | 1,896   | 1,819  | 540      | 80,186    | 小売                     |
| PEARSON PLC                  | 702     | 662    | 610      | 90,499    | メディア                   |
| SEVERN TRENT PLC             | 207     | 191    | 377      | 56,032    | 公益事業                   |
| RIO TINTO PLC                | 1,037   | 971    | 4,104    | 608,624   | 素材                     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 4,096   | 3,939  | 5,776    | 856,429   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | 125     | —      | —        | —         | 各種金融                   |
| 3I GROUP PLC                 | 795     | 782    | 767      | 113,818   | 各種金融                   |
| GKN PLC                      | 1,460   | —      | —        | —         | 自動車・自動車部品              |
| VODAFONE GROUP PLC           | 22,328  | 21,368 | 4,489    | 665,663   | 電気通信サービス               |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 1,902   | 1,697  | 430      | 63,838    | 食品・生活必需品小売り            |
| SAINSBURY (J) PLC            | 1,385   | 1,421  | 435      | 64,601    | 食品・生活必需品小売り            |
| AVIVA PLC                    | 3,411   | 3,220  | 1,747    | 259,115   | 保険                     |
| CAPITA PLC                   | 536     | —      | —        | —         | 商業・専門サービス              |
| DIXONS CARPHONE PLC          | 843     | —      | —        | —         | 小売                     |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 165     | 155    | 539      | 80,058    | 素材                     |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 833     | 840    | 549      | 81,459    | 保険                     |
| WHITBREAD PLC                | 155     | 148    | 628      | 93,117    | 消費者サービス                |
| NATIONAL GRID PLC            | 3,171   | 2,727  | 2,308    | 342,253   | 公益事業                   |
| FERGUSON PLC                 | 211     | 200    | 1,134    | 168,242   | 資本財                    |
| BUNZL PLC                    | 276     | 262    | 587      | 87,147    | 資本財                    |
| COBHAM PLC                   | 2,080   | 1,705  | 200      | 29,720    | 資本財                    |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 1,177   | 1,070  | 1,990    | 295,057   | 素材                     |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当 期 末    |           | 業 種 等                  |
|------------------------------|---------|-------|----------|-----------|------------------------|
|                              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額    |           |                        |
|                              |         |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                        |
| (イギリス)                       | 百株      | 百株    | 千イギリスポンド | 千円        |                        |
| INTERTEK GROUP PLC           | 133     | 132   | 674      | 100,038   | 商業・専門サービス              |
| WILLIAM HILL PLC             | 740     | —     | —        | —         | 消費者サービス                |
| BURBERRY GROUP PLC           | 362     | 346   | 626      | 92,881    | 耐久消費財・アパレル             |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 159     | 146   | 698      | 103,631   | 消費者サービス                |
| CARNIVAL PLC                 | 157     | 149   | 723      | 107,262   | 消費者サービス                |
| PERSIMMON PLC                | 252     | 250   | 699      | 103,645   | 耐久消費財・アパレル             |
| MEGGITT PLC                  | 620     | 565   | 275      | 40,842    | 資本財                    |
| ITV PLC                      | 3,089   | 2,817 | 484      | 71,860    | メディア                   |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 261     | 250   | 1,110    | 164,666   | 各種金融                   |
| G4S PLC                      | 1,335   | 1,159 | 313      | 46,488    | 商業・専門サービス              |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 107     | 99    | 419      | 62,186    | 耐久消費財・アパレル             |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 854     | 781   | 438      | 65,038    | 耐久消費財・アパレル             |
| IMI PLC                      | 217     | 192   | 207      | 30,839    | 資本財                    |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 733     | 702   | 911      | 135,114   | ヘルスケア機器・サービス           |
| TATE & LYLE PLC              | 373     | —     | —        | —         | 食品・飲料・タバコ              |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 2,778   | 2,655 | 518      | 76,891    | 耐久消費財・アパレル             |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 3,664   | 3,638 | 9,663    | 1,432,828 | エネルギー                  |
| PETROFAC LTD                 | 227     | —     | —        | —         | エネルギー                  |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 214     | 179   | 233      | 34,690    | 資本財                    |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 3,146   | 2,999 | 8,129    | 1,205,291 | エネルギー                  |
| OLD MUTUAL PLC               | 4,088   | 3,961 | 1,028    | 152,531   | 保険                     |
| INVESTEC PLC                 | 558     | 491   | 288      | 42,756    | 各種金融                   |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC   | 1,799   | 2,145 | 795      | 117,976   | 各種金融                   |
| EXPERIAN PLC                 | 801     | 743   | 1,290    | 191,320   | 商業・専門サービス              |
| MONDI PLC                    | 301     | 299   | 599      | 88,859    | 素材                     |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 186     | 198   | 452      | 67,098    | 資本財                    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 295     | 286   | 786      | 116,659   | 食品・飲料・タバコ              |
| ANTOFAGASTA PLC              | 342     | 286   | 299      | 44,419    | 素材                     |
| SHIRE PLC                    | 757     | 726   | 2,952    | 437,797   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INMARSAT PLC                 | 394     | —     | —        | —         | 電気通信サービス               |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 183     | 148   | 287      | 42,691    | 保険                     |
| FRESNILLO PLC                | 175     | 155   | 202      | 29,974    | 素材                     |
| RANDGOLD RESOURCES LTD       | 78      | 72    | 426      | 63,192    | 素材                     |
| BABCOCK INTL GROUP PLC       | 218     | 227   | 173      | 25,787    | 商業・専門サービス              |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 451     | 422   | 501      | 74,390    | 各種金融                   |
| GLENCORE PLC                 | 10,267  | 9,805 | 3,785    | 561,318   | 素材                     |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC      | 827     | —     | —        | —         | 各種金融                   |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 207     | 196   | 370      | 54,944    | 各種金融                   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 111     | 107   | 498      | 73,905    | 素材                     |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       | —       | 3,769 | 878      | 130,322   | 資本財                    |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 154     | 139   | 351      | 52,107    | 食品・飲料・タバコ              |
| EASYJET PLC                  | 141     | 118   | 202      | 30,083    | 運輸                     |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 1,112   | 1,067 | 395      | 58,634    | 保険                     |
| ROYAL MAIL PLC               | 770     | 686   | 433      | 64,257    | 運輸                     |
| ASHTED GROUP PLC             | 414     | 400   | 893      | 132,508   | 資本財                    |
| MERLIN ENTERTAINMENT         | 566     | 651   | 243      | 36,126    | 消費者サービス                |
| TUI AG-DI                    | 422     | 358   | 633      | 93,923    | 消費者サービス                |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL    | —       | 330   | 430      | 63,762    | ソフトウェア・サービス            |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 125     | —     | —        | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 322     | 339   | 234      | 34,785    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 841     | 695   | 264      | 39,223    | ソフトウェア・サービス            |
| WORLDPAY GROUP PLC           | 1,488   | —     | —        | —         | ソフトウェア・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                 |  |
| (イギリス)                       | 百株                        | 百株             | 千イギリスポンド      | 千円           |                        |  |
| DCC PLC                      | 73                        | 71             | 519           | 76,980       | 資本財                    |  |
| GVC HOLDINGS PLC             | —                         | 413            | 361           | 53,663       | 消費者サービス                |  |
| CONVATEC GROUP PLC           | —                         | 1,236          | 282           | 41,907       | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC        | —                         | 525            | 340           | 50,554       | エネルギー                  |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 < 比 率 > | 364,644<br>105 | 332,787<br>99 | 156,832<br>— | 23,253,621<br><6.9%>   |  |
| (スイス)                        |                           |                | 千スイスフラン       |              |                        |  |
| NESTLE SA-REG                | 2,611                     | 2,489          | 19,321        | 2,114,533    | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 439                       | 418            | 4,039         | 442,078      | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 1,723                     | 1,941          | 3,328         | 364,238      | 各種金融                   |  |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 383                       | 364            | 1,925         | 210,673      | 素材                     |  |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 589                       | 562            | 12,486        | 1,366,509    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| GIVAUDAN-REG                 | 7                         | 7              | 1,698         | 185,883      | 素材                     |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 43                        | 40             | 674           | 73,799       | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 126                       | 121            | 3,842         | 420,523      | 保険                     |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     | —                         | 8              | 606           | 66,334       | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SYNGENTA AG-REG              | 77                        | —              | —             | —            | 素材                     |  |
| LONZA GROUP AG-REG           | 50                        | 59             | 1,585         | 173,552      | 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      | 43                        | 39             | 352           | 38,595       | 耐久消費財・アパレル             |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 34                        | 34             | 745           | 81,553       | 資本財                    |  |
| GEBERIT AG-REG               | 31                        | 29             | 1,329         | 145,486      | 資本財                    |  |
| SWISS RE AG                  | 272                       | 251            | 2,395         | 262,114      | 保険                     |  |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 25                        | 25             | 1,237         | 135,457      | 耐久消費財・アパレル             |  |
| PARGESA HOLDING SA-BR        | 31                        | 26             | 239           | 26,174       | 各種金融                   |  |
| NOVARTIS AG-REG              | 1,874                     | 1,779          | 13,802        | 1,510,494    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 137                       | 133            | 859           | 94,118       | 商業・専門サービス              |  |
| SWISSCOM AG-REG              | 21                        | 21             | 973           | 106,566      | 電気通信サービス               |  |
| ABB LTD-REG                  | 1,584                     | 1,473          | 3,547         | 388,247      | 資本財                    |  |
| CLARIANT AG-REG              | —                         | 191            | 464           | 50,829       | 素材                     |  |
| SGS SA-REG                   | 4                         | 4              | 1,038         | 113,674      | 商業・専門サービス              |  |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 17                        | 14             | 302           | 33,084       | 資本財                    |  |
| ACTELION LTD-REG             | 81                        | —              | —             | —            | 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   | 45                        | 43             | 672           | 73,622       | 運輸                     |  |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 41                        | 39             | 610           | 66,821       | 保険                     |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 27                        | 26             | 958           | 104,847      | 保険                     |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 0.08                      | 0.08           | 600           | 65,664       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ARYZTA AG                    | 76                        | —              | —             | —            | 食品・飲料・タバコ              |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 191                       | 179            | 1,127         | 123,379      | 各種金融                   |  |
| SIKA AG-BR                   | 1                         | 1              | 1,406         | 153,926      | 素材                     |  |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 60                        | 56             | 528           | 57,793       | 不動産                    |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 0.9                       | 0.88           | 560           | 61,299       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 15                        | 14             | 1,051         | 115,111      | 各種金融                   |  |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 1                         | 1              | 291           | 31,886       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 7                         | 7              | 462           | 50,567       | 素材                     |  |
| UBS GROUP AG-REG             | 3,075                     | 2,926          | 4,808         | 526,246      | 各種金融                   |  |
| DUFREY AG-REG                | 30                        | 25             | 376           | 41,156       | 小売                     |  |
| VIFOR PHARMA AG              | 3                         | 38             | 611           | 66,899       | 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<br>銘柄 数 < 比 率 > | 13,793<br>38   | 13,398<br>37  | 90,860<br>—  | 9,943,746<br><2.9%>    |  |
| (スウェーデン)                     |                           |                | 千スウェーデンクローネ   |              |                        |  |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 204                       | 187            | 4,255         | 54,130       | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ERICSSON LM-B SHS            | 2,581                     | 2,457          | 16,778        | 213,417      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |

| 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   |              |                        |  |
| (スウェーデン)                     | 百株                  | 百株           | 千スウェーデンクローネ 千円 |              |                        |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 323                 | 314          | 10,031         | 127,599      | 資本財                    |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,276               | 1,217        | 10,366         | 131,868      | 銀行                     |  |
| INVESTOR AB-B SHS            | 380                 | 363          | 13,856         | 176,251      | 各種金融                   |  |
| NORDEA BANK AB               | 2,546               | 2,432        | 22,199         | 282,380      | 銀行                     |  |
| GETINGE AB-B SHS             | 173                 | 143          | 1,220          | 15,520       | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 1,283               | 1,225        | 12,256         | 155,906      | 銀行                     |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 567                 | 535          | 18,803         | 239,179      | 資本財                    |  |
| SKF AB-B SHARES              | 325                 | 297          | 5,469          | 69,576       | 資本財                    |  |
| ASSA ABLOY AB-B              | 842                 | 802          | 15,356         | 195,328      | 資本財                    |  |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 795                 | 758          | 10,535         | 134,016      | 小売                     |  |
| SANDVIK AB                   | 892                 | 903          | 14,243         | 181,177      | 資本財                    |  |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 760                 | 726          | 14,176         | 180,320      | 銀行                     |  |
| SECURITAS AB-B SHS           | 266                 | 230          | 3,185          | 40,519       | 商業・専門サービス              |  |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 511                 | —            | —              | —            | 素材                     |  |
| SKANSKA AB-B SHS             | 287                 | 250          | 4,134          | 52,592       | 資本財                    |  |
| SWEDISH MATCH AB             | 161                 | 145          | 5,974          | 75,990       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TELE2 AB-B SHS               | 285                 | 256          | 2,956          | 37,606       | 電気通信サービス               |  |
| TELIA CO AB                  | 2,145               | 2,270        | 9,887          | 125,765      | 電気通信サービス               |  |
| VOLVO AB-B SHS               | 1,302               | 1,249        | 19,618         | 249,544      | 資本財                    |  |
| ALFA LAVAL AB                | 249                 | 226          | 5,143          | 65,420       | 資本財                    |  |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 148                 | 164          | 4,440          | 56,481       | エネルギー                  |  |
| BOLIDEN AB                   | 232                 | 222          | 7,169          | 91,192       | 素材                     |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 362                 | 381          | 3,278          | 41,699       | 耐久消費財・アパレル             |  |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR   | 52                  | 46           | 2,648          | 33,691       | 電気通信サービス               |  |
| HEXAGON AB-B SHS             | 216                 | 208          | 9,891          | 125,815      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| KINNEVIK AB - B              | 197                 | 185          | 5,947          | 75,652       | 各種金融                   |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 140                 | 150          | 2,926          | 37,223       | 各種金融                   |  |
| ICA GRUPPEN AB               | 69                  | 72           | 2,010          | 25,579       | 食品・生活必需品小売り            |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS           | 31                  | 33           | 2,011          | 25,583       | 各種金融                   |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          | —                   | 484          | 11,093         | 141,114      | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION  | —                   | 289          | 231            | 2,948        | 資本財                    |  |
| ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION  | —                   | 494          | 395            | 5,028        | 資本財                    |  |
| 小 計                          | 株 数<br>銘柄 数 < 比 率 > | 19,614<br>31 | 19,728<br>33   | 272,494<br>— | 3,466,125<br><1.0%>    |  |
| (ノルウェー)                      |                     |              | 千ノルウェークローネ     |              |                        |  |
| DNB ASA                      | 822                 | 785          | 12,279         | 167,739      | 銀行                     |  |
| NORSK HYDRO ASA              | 1,132               | 1,047        | 5,066          | 69,210       | 素材                     |  |
| ORKLA ASA                    | 693                 | 665          | 4,927          | 67,312       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| STATOIL ASA                  | 952                 | 931          | 20,186         | 275,741      | エネルギー                  |  |
| TELENOR ASA                  | 621                 | 602          | 10,449         | 142,743      | 電気通信サービス               |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 150                 | 139          | 4,647          | 63,490       | 素材                     |  |
| MARINE HARVEST               | 308                 | 334          | 5,661          | 77,329       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 171                 | 137          | 1,735          | 23,701       | 保険                     |  |
| SCHIBSTED ASA-CL A           | 66                  | —            | —              | —            | メディア                   |  |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          | 75                  | 80           | 1,750          | 23,918       | メディア                   |  |
| 小 計                          | 株 数<br>銘柄 数 < 比 率 > | 4,995<br>10  | 4,723<br>9     | 66,704<br>—  | 911,187<br><0.3%>      |  |
| (デンマーク)                      |                     |              | 千デンマーククローネ     |              |                        |  |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 1,605               | 1,491        | 44,769         | 785,261      | 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       | 188                 | 185          | 5,870          | 102,964      | 素材                     |  |
| DANSKE BANK A/S              | 581                 | 598          | 12,874         | 225,812      | 銀行                     |  |
| WILLIAM DEMANT HOLDING       | 104                 | 82           | 1,967          | 34,502       | ヘルスケア機器・サービス           |  |

| 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                 |     |
| (デンマーク)                      | 百株      | 百株    | 千デンマーククローネ | 千円      |                        |     |
| H LUNDBECK A/S               | —       | 62    | 2,590      | 45,442  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 186     | 172   | 7,574      | 132,857 | 資本財                    |     |
| TDC A/S                      | 653     | —     | —          | —       | 電気通信サービス               |     |
| CARLSBERG AS-B               | 88      | 87    | 6,206      | 108,857 | 食品・飲料・タバコ              |     |
| COLOPLAST-B                  | 101     | 96    | 5,715      | 100,256 | ヘルスケア機器・サービス           |     |
| DSV A/S                      | 157     | 152   | 7,833      | 137,395 | 運輸                     |     |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 5       | 5     | 5,636      | 98,859  | 運輸                     |     |
| TRYG A/S                     | 97      | 87    | 1,281      | 22,476  | 保険                     |     |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 3       | 2     | 2,859      | 50,161  | 運輸                     |     |
| PANDORA A/S                  | 92      | 86    | 6,003      | 105,294 | 耐久消費財・アパレル             |     |
| ISS A/S                      | 143     | 127   | 2,816      | 49,397  | 商業・専門サービス              |     |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | 84      | 79    | 4,608      | 80,828  | 素材                     |     |
| GENMAB A/S                   | 48      | 47    | 5,880      | 103,142 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |
| ORSTED A/S                   | 122     | 153   | 6,158      | 108,023 | 公益事業                   |     |
| 小計                           | 株数・金額   | 4,265 | 3,518      | 130,646 | 2,291,533              |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 17    | 17         | —       | <0.7%>                 |     |
| (オーストラリア)                    |         |       | 千オーストラリアドル |         |                        |     |
| BHP BILLITON LIMITED         | 2,700   | 2,576 | 8,543      | 706,239 | 素材                     |     |
| CSL LTD                      | 383     | 362   | 6,363      | 526,012 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |
| ALUMINA LTD                  | 2,161   | 2,184 | 600        | 49,646  | 素材                     |     |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 641     | 749   | 2,513      | 207,740 | エネルギー                  |     |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    | 2,467   | 2,355 | 6,630      | 548,103 | 銀行                     |     |
| RTO TINTO LTD                | 359     | 332   | 2,787      | 230,393 | 銀行                     |     |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 1,153   | 1,123 | 1,147      | 94,819  | 保険                     |     |
| LENLEASE GROUP               | 479     | 424   | 770        | 63,654  | 不動産                    |     |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 1,450   | 1,404 | 9,906      | 818,889 | 銀行                     |     |
| WESTPAC BANKING CORP         | 2,818   | 2,720 | 8,050      | 665,495 | 銀行                     |     |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 2,240   | 2,154 | 6,118      | 505,771 | 銀行                     |     |
| BRAMBLES LTD                 | 1,331   | 1,296 | 1,277      | 105,565 | 商業・専門サービス              |     |
| QANTAS AIRWAYS LTD           | 469     | —     | —          | —       | 運輸                     |     |
| BORAL LTD                    | 964     | 920   | 625        | 51,687  | 素材                     |     |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         | 1,089   | 1,047 | 2,996      | 247,700 | 食品・生活必需品小売り            |     |
| TELSTRA CORP LTD             | 3,534   | 3,433 | 1,098      | 90,816  | 電気通信サービス               |     |
| AMP LTD                      | 2,488   | 2,446 | 912        | 75,438  | 各種金融                   |     |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 753     | 1,472 | 670        | 55,391  | 消費者サービス                |     |
| AMCOR LIMITED                | 976     | 947   | 1,315      | 108,764 | 素材                     |     |
| COMPUTERSHARE LTD            | 386     | 359   | 633        | 52,379  | ソフトウェア・サービス            |     |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 451     | 442   | 1,250      | 103,371 | 消費者サービス                |     |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 261     | 260   | 2,948      | 243,742 | 各種金融                   |     |
| CIMIC GROUP LTD              | 88      | 91    | 404        | 33,408  | 資本財                    |     |
| ASX LTD                      | 160     | 160   | 994        | 82,218  | 各種金融                   |     |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 507     | 393   | 356        | 29,427  | 食品・飲料・タバコ              |     |
| COCHLEAR LTD                 | 50      | 46    | 919        | 76,041  | ヘルスケア機器・サービス           |     |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 382     | 363   | 855        | 70,731  | 素材                     |     |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD   | 515     | 521   | 181        | 14,969  | 小売                     |     |
| NEWCREST MINING LTD          | 636     | 624   | 1,387      | 114,674 | 素材                     |     |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 2,002   | 1,917 | 1,575      | 130,258 | 保険                     |     |
| ORIGIN ENERGY LTD            | 1,465   | 1,418 | 1,396      | 115,465 | エネルギー                  |     |
| ORICA LTD                    | 325     | 277   | 511        | 42,253  | 素材                     |     |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 345     | 318   | 754        | 62,369  | ヘルスケア機器・サービス           |     |
| SANTOS LTD                   | 1,566   | 1,469 | 911        | 75,308  | エネルギー                  |     |
| SUNCORP GROUP LTD            | 1,095   | 1,053 | 1,463      | 120,959 | 保険                     |     |

| 銘柄                           | 株数      | 株数     | 期末          |         | 業種等          |  |
|------------------------------|---------|--------|-------------|---------|--------------|--|
|                              |         |        | 評価額         | 金額      |              |  |
|                              |         |        | 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      |              |  |
| TRANSURBAN GROUP             | 1,753   | 1,793  | 2,127       | 175,857 | 運輸           |  |
| WESFARMERS LTD               | 954     | 908    | 4,001       | 330,741 | 食品・生活必需品小売り  |  |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | —       | 432    | 766         | 63,378  | 素材           |  |
| CHALLENGER LTD               | 473     | 432    | 542         | 44,836  | 各種金融         |  |
| SYDNEY AIRPORT               | 921     | 851    | 607         | 50,231  | 運輸           |  |
| CALTEX AUSTRALIA LTD         | 218     | 204    | 621         | 51,381  | エネルギー        |  |
| OIL SEARCH LTD               | 1,187   | 1,098  | 933         | 77,172  | エネルギー        |  |
| AGL ENERGY LTD               | 566     | 539    | 1,183       | 97,865  | 公益事業         |  |
| TATTS GROUP LTD              | 1,202   | —      | —           | —       | 消費者サービス      |  |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 1,332   | 1,146  | 565         | 46,735  | 素材           |  |
| AUSNET SERVICES              | 1,740   | 1,869  | 324         | 26,804  | 公益事業         |  |
| CROWN RESORTS LTD            | 324     | 266    | 357         | 29,533  | 消費者サービス      |  |
| INCITEC PIVOT LTD            | 1,458   | 1,244  | 436         | 36,110  | 素材           |  |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK    | 384     | 438    | 470         | 38,923  | 銀行           |  |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 1,713   | 1,595  | 701         | 58,026  | 運輸           |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 608     | 596    | 1,116       | 92,288  | 食品・飲料・タバコ    |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 117     | 115    | 744         | 61,572  | ヘルスケア機器・サービス |  |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | 50      | 51     | 314         | 26,005  | 消費者サービス      |  |
| SEEK LTD                     | 272     | 300    | 624         | 51,587  | 商業・専門サービス    |  |
| BANK OF QUEENSLAND LTD       | 316     | 382    | 385         | 31,845  | 銀行           |  |
| REA GROUP LTD                | 48      | 49     | 442         | 36,612  | ソフトウェア・サービス  |  |
| TPG TELECOM LTD              | 306     | 341    | 197         | 16,317  | 電気通信サービス     |  |
| HEALTHSCOPE LTD              | 1,564   | 1,606  | 396         | 32,803  | ヘルスケア機器・サービス |  |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         | 2,282   | 2,135  | 646         | 53,475  | 保険           |  |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 56      | 58     | 249         | 20,604  | 消費者サービス      |  |
| SOUTH32 LTD                  | 4,400   | 4,168  | 1,642       | 135,768 | 素材           |  |
| VOCUS GROUP LTD              | 465     | —      | —           | —       | 電気通信サービス     |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 63,425 | 60,303      | 99,276  | 8,206,190    |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 61     | 59          | —       | <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        | 1,586   | 1,288  | 456         | 34,779  | 電気通信サービス     |  |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 830     | 863    | 575         | 43,850  | 運輸           |  |
| CONTACT ENERGY LTD           | 644     | —      | —           | —       | 公益事業         |  |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | —       | 458    | 596         | 45,459  | ヘルスケア機器・サービス |  |
| FLETCHER BUILDING LTD        | 598     | 629    | 402         | 30,668  | 素材           |  |
| RYMAN HEALTHCARE LTD         | 323     | 360    | 409         | 31,237  | ヘルスケア機器・サービス |  |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | 1,136   | 851    | 251         | 19,210  | 公益事業         |  |
| MERCURY NZ LTD               | 643     | 643    | 204         | 15,593  | 公益事業         |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 5,763  | 5,095       | 2,895   | 220,798      |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 7      | 7           | —       | <0.1%>       |  |
| (香港)                         |         |        | 千香港ドル       |         |              |  |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 1,140   | 920    | 2,369       | 33,000  | 不動産          |  |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 470     | 365    | 2,888       | 40,243  | 不動産          |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 2,283   | 2,163  | 19,981      | 278,343 | 資本財          |  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 1,220   | 1,160  | 14,732      | 205,216 | 不動産          |  |
| MTR CORP                     | 1,215   | 1,180  | 5,363       | 74,707  | 運輸           |  |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 6,483   | 6,831  | 11,504      | 160,258 | 公益事業         |  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 4,620   | 4,940  | 5,740       | 79,962  | 不動産          |  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 1,160   | 1,155  | 6,854       | 95,489  | 公益事業         |  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 983     | 943    | 24,706      | 344,162 | 各種金融         |  |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS       | 1,140   | —      | —           | —       | 運輸           |  |
| HANG LUNG GROUP LTD          | 700     | 850    | 2,086       | 29,068  | 不動産          |  |



| 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      |             |  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 1,940   | 1,490  | 2,777     | 38,688  | 不動産         |  |
| CLP HOLDINGS LTD             | 1,390   | 1,335  | 10,993    | 153,142 | 公益事業        |  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 943     | 935    | 4,749     | 66,162  | 不動産         |  |
| BANK OF EAST ASIA LTD        | 988     | 908    | 3,110     | 43,330  | 銀行          |  |
| HANG SENG BANK LTD           | 642     | 613    | 12,358    | 172,148 | 銀行          |  |
| HYSAN DEVELOPMENT CO         | 550     | 570    | 2,533     | 35,293  | 不動産         |  |
| SHANGRI-LA ASIA LTD          | 1,160   | 1,220  | 1,810     | 25,219  | 消費者サービス     |  |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 197     | 244    | 2,481     | 34,567  | 半導体・半導体製造装置 |  |
| SINO LAND CO                 | 2,474   | 2,294  | 3,037     | 42,308  | 不動産         |  |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     | 650     | 480    | 1,080     | 15,044  | 耐久消費財・アパレル  |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 550     | 505    | 3,178     | 44,283  | 公益事業        |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 3,120   | 2,965  | 12,052    | 167,894 | 銀行          |  |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 1,175   | 1,105  | 5,292     | 73,730  | 耐久消費財・アパレル  |  |
| PCCW LTD                     | 3,900   | 4,060  | 1,985     | 27,655  | 電気通信サービス    |  |
| LI & FUNG LTD                | 5,220   | 5,420  | 2,336     | 32,540  | 耐久消費財・アパレル  |  |
| KERRY PROPERTIES LTD         | 575     | 605    | 2,341     | 32,615  | 不動産         |  |
| MINTH GROUP LTD              | —       | 540    | 2,073     | 28,885  | 自動車・自動車部品   |  |
| NWS HOLDINGS LTD             | 1,355   | 1,465  | 2,171     | 30,243  | 資本財         |  |
| SANDS CHINA LTD              | 2,008   | 1,948  | 9,223     | 128,487 | 消費者サービス     |  |
| WHEELLOCK & CO LTD           | 670     | 620    | 3,527     | 49,142  | 不動産         |  |
| WYNN MACAU LTD               | 1,388   | 1,176  | 3,516     | 48,981  | 消費者サービス     |  |
| SJM HOLDINGS LTD             | 1,720   | 1,750  | 1,576     | 21,964  | 消費者サービス     |  |
| FIRST PACIFIC CO             | 1,980   | 2,000  | 806       | 11,227  | 各種金融        |  |
| AIA GROUP LTD                | 10,142  | 9,666  | 70,368    | 980,232 | 保険          |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD         | 1,014   | 834    | 2,510     | 34,969  | 不動産         |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 1,990   | 1,890  | 13,135    | 182,977 | 消費者サービス     |  |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD       | 852     | 884    | 2,024     | 28,199  | 消費者サービス     |  |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 3,240   | 2,760  | 2,892     | 40,292  | 電気通信サービス    |  |
| WH GROUP LTD                 | 6,570   | 6,945  | 5,535     | 77,104  | 食品・飲料・タバコ   |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        | 2,268   | 2,068  | 14,108    | 196,529 | 不動産         |  |
| KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD | —       | 4,160  | 1,655     | 23,063  | 各種金融        |  |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | —       | 1,020  | 6,313     | 87,951  | 不動産         |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 82,087 | 84,985    | 309,786 | 4,315,331   |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 40     | 42        | —       | <1.3%>      |  |
| (シンガポール)                     |         |        | 千シンガポールドル |         |             |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 2,640   | 2,498  | 3,282     | 269,154 | 銀行          |  |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 1,419   | 1,061  | 294       | 24,110  | メディア        |  |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 903     | 926    | 287       | 23,538  | 資本財         |  |
| CAPITALAND LTD               | 2,094   | 2,012  | 738       | 60,549  | 不動産         |  |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 319     | 378    | 473       | 38,837  | 不動産         |  |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 78      | 63     | 213       | 17,481  | 小売          |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 1,496   | 1,428  | 4,208     | 345,081 | 銀行          |  |
| KEPPEL CORP LTD              | 1,186   | 1,218  | 1,006     | 82,497  | 資本財         |  |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 1,109   | 1,061  | 3,146     | 258,047 | 銀行          |  |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 1,266   | 1,445  | 489       | 40,168  | 資本財         |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 6,864   | 6,468  | 2,296     | 188,300 | 電気通信サービス    |  |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 496     | 439    | 489       | 40,174  | 運輸          |  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 702     | 615    | 474       | 38,881  | 各種金融        |  |
| UOL GROUP LTD                | 428     | 443    | 386       | 31,676  | 不動産         |  |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       | 1,894   | 2,010  | 468       | 38,403  | 運輸          |  |
| STARHUB LTD                  | 570     | 582    | 126       | 10,403  | 電気通信サービス    |  |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 6,368   | 6,395  | 233       | 19,142  | 食品・飲料・タバコ   |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末)      |           | 当 期 末      |        | 業 種 等       |  |
|------------------------------|--------------|-----------|------------|--------|-------------|--|
|                              | 株 数          | 株 数       | 評 価 額      |        |             |  |
|                              |              |           | 外貨建金額      | 邦貨換算金額 |             |  |
| (シンガポール)                     | 百株           | 百株        | 千シンガポールドル  | 千円     |             |  |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 1,666        | 1,469     | 464        | 38,064 | 食品・飲料・タバコ   |  |
| GENTING SINGAPORE PLC        | 5,212        | 4,435     | 567        | 46,549 | 消費者サービス     |  |
| SATS LTD                     | 610          | 650       | 362        | 29,688 | 運輸          |  |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 2,302        | —         | —          | —      | 不動産         |  |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING     | 1,665        | 2,085     | 248        | 20,345 | 資本財         |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 41,289    | 37,683     | 20,257 | 1,661,098   |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 22        | 21         | —      | <0.5%>      |  |
| (イスラエル)                      |              |           | 千イスラエルシェケル |        |             |  |
| ISRAEL CHEMICALS LTD         | 447          | 483       | 798        | 24,414 | 素材          |  |
| BANK HAPOALIM BM             | 913          | 846       | 2,194      | 67,053 | 銀行          |  |
| NICE LTD                     | 48           | 46        | 1,653      | 50,535 | ソフトウェア・サービス |  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 1,238        | 1,192     | 2,622      | 80,152 | 銀行          |  |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | 20           | 22        | 895        | 27,362 | 資本財         |  |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 1,815        | 1,865     | 782        | 23,899 | 電気通信サービス    |  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 121          | 125       | 851        | 26,018 | 銀行          |  |
| AZRIELI GROUP LTD            | 35           | 37        | 627        | 19,175 | 不動産         |  |
| FRUTAROM                     | 34           | 26        | 896        | 27,386 | 素材          |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 4,674     | 4,644      | 11,321 | 345,997     |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 9         | 9          | —      | <0.1%>      |  |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 1,097,576 | 1,002,429  | —      | 318,482,921 |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 1,262     | 1,262      | —      | <94.4%>     |  |

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

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

外国投資信託証券

| 銘柄                           | 期首(前期末)      |       | 当 期 末   |         |           |     |
|------------------------------|--------------|-------|---------|---------|-----------|-----|
|                              | 口 数          | 口 数   | 評 価 額   |         | 比 率       |     |
|                              |              |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |           |     |
| (アメリカ)                       | 千口           | 千口    | 千アメリカドル | 千円      | %         |     |
| HCP INC                      | 38           | 37    | 903     | 98,738  | 0.0       |     |
| MACERICH CO/THE              | 10           | 9     | 540     | 59,029  | 0.0       |     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 6            | 7     | 980     | 107,139 | 0.0       |     |
| PROLOGIS INC                 | 44           | 42    | 2,778   | 303,716 | 0.1       |     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 7            | 7     | 639     | 69,885  | 0.0       |     |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 12           | 11    | 450     | 49,194  | 0.0       |     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 13           | 16    | 1,788   | 195,477 | 0.1       |     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 5            | 5     | 1,280   | 139,973 | 0.0       |     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 10           | 10    | 970     | 106,116 | 0.0       |     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 5            | 5     | 705     | 77,162  | 0.0       |     |
| WELLTOWER INC                | 30           | 29    | 1,664   | 181,896 | 0.1       |     |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 12           | 12    | 1,535   | 167,828 | 0.0       |     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 9            | 8     | 826     | 90,368  | 0.0       |     |
| REALTY INCOME CORP           | 21           | 22    | 1,193   | 130,408 | 0.0       |     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 12           | 12    | 707     | 77,390  | 0.0       |     |
| SL GREEN REALTY CORP         | 8            | 8     | 809     | 88,480  | 0.0       |     |
| UDR INC                      | 21           | 20    | 761     | 83,189  | 0.0       |     |
| VENTAS INC                   | 29           | 28    | 1,522   | 166,420 | 0.0       |     |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 86           | 93    | 971     | 106,207 | 0.0       |     |
| WEYERHAEUSER CO              | 63           | 60    | 2,209   | 241,540 | 0.1       |     |
| AMERICAN TOWER CORP          | 35           | 34    | 4,764   | 520,814 | 0.2       |     |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 28           | 31    | 600     | 65,617  | 0.0       |     |
| VEREIT INC                   | 83           | 83    | 589     | 64,482  | 0.0       |     |
| DUKE REALTY CORP             | 29           | 29    | 835     | 91,299  | 0.0       |     |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 25           | 22    | 324     | 35,417  | 0.0       |     |
| IRON MOUNTAIN INC            | 20           | 22    | 745     | 81,498  | 0.0       |     |
| EQUINIX INC                  | 6            | 6     | 2,514   | 274,873 | 0.1       |     |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 30           | 32    | 3,367   | 368,104 | 0.1       |     |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 30           | 29    | 1,837   | 200,901 | 0.1       |     |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 44           | 47    | 294     | 32,138  | 0.0       |     |
| INVITATION HOMES INC         | —            | 25    | 615     | 67,268  | 0.0       |     |
| GGP INC                      | 47           | 46    | 960     | 104,994 | 0.0       |     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 61           | 59    | 1,225   | 133,906 | 0.0       |     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 12           | 11    | 479     | 52,437  | 0.0       |     |
| PUBLIC STORAGE               | 12           | 12    | 2,649   | 289,564 | 0.1       |     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 26           | 24    | 3,977   | 434,772 | 0.1       |     |
| VORNADO REALTY TRUST         | 14           | 13    | 969     | 105,991 | 0.0       |     |
| KIMCO REALTY CORP            | 36           | 33    | 477     | 52,236  | 0.0       |     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 11           | 11    | 1,834   | 200,566 | 0.1       |     |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 1,008 | 1,027   | 52,301  | 5,717,053 |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 38    | 39      | —       | < 1.7% >  |     |
| (カナダ)                        |              |       |         | 千カナダドル  |           |     |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV |              | 5     | 5       | 163     | 13,975    | 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        | %   |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS |              | 12    | 12    | 254        | 21,813    | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  |              | 13    | 13    | 327        | 28,035    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 31    | 31    | 746        | 63,824    |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 3     | 3     | —          | <0.0%>    |     |
| (ユーロ…フランス)                   |              |       |       | 千ユーロ       |           |     |
| GEICINA SA                   |              | 3     | 3     | 545        | 71,269    | 0.0 |
| KLEPIERRE                    |              | 17    | 17    | 608        | 79,553    | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           |              | 8     | 7     | 1,558      | 203,765   | 0.1 |
| FONCIERE DES REGIONS         |              | 2     | 3     | 298        | 39,012    | 0.0 |
| ICADE                        |              | 3     | 3     | 250        | 32,792    | 0.0 |
| ユ ー ロ 計                      | 口 数 ・ 金 額    | 35    | 35    | 3,262      | 426,392   |     |
|                              | 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          |              | 83    | 79    | 551        | 81,709    | 0.0 |
| HAMMERSON PLC                |              | 66    | 59    | 332        | 49,264    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |              | 65    | 60    | 586        | 86,989    | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC          |              | 83    | —     | —          | —         | —   |
| SEGRO PLC                    |              | 84    | 79    | 518        | 76,903    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 382   | 277   | 1,988      | 294,867   |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 5     | 4     | —          | <0.1%>    |     |
| (オーストラリア)                    |              |       |       | 千オーストラリアドル |           |     |
| VICINITY CENTRES             |              | 291   | 258   | 663        | 54,856    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                |              | 452   | 427   | 1,759      | 145,401   | 0.0 |
| GPT GROUP                    |              | 147   | 137   | 669        | 55,300    | 0.0 |
| MIRVAC GROUP                 |              | 303   | 283   | 642        | 53,149    | 0.0 |
| STOCKLAND                    |              | 209   | 199   | 841        | 69,545    | 0.0 |
| WESTFIELD CORP               |              | 166   | 158   | 1,442      | 119,205   | 0.0 |
| DEXUS                        |              | 84    | 80    | 777        | 64,300    | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                |              | 150   | 145   | 1,323      | 109,402   | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 1,806 | 1,691 | 8,119      | 671,161   |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 8     | 8     | —          | <0.2%>    |     |
| (香港)                         |              |       |       | 千香港ドル      |           |     |
| LINK REIT                    |              | 190   | 176   | 11,906     | 165,856   | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 190   | 176   | 11,906     | 165,856   |     |
|                              | 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                  |              | 217   | 239   | 456        | 37,463    | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  |              | 184   | 204   | 362        | 29,710    | 0.0 |
| CAPITALAND MALL TRUST        |              | 218   | 176   | 370        | 30,393    | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |              | 194   | 182   | 486        | 39,890    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 815   | 802   | 1,676      | 137,457   |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 4     | 4     | —          | <0.0%>    |     |
| 合 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 4,269 | 4,041 | —          | 7,476,613 |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 64    | 64    | —          | <2.2%>    |     |

(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<br>国 | 株式先物取引 |          | 百万円   | 百万円   |
|        |        | SP EMINI | 7,638 | —     |
|        |        | SP/TSE60 | 453   | —     |
|        |        | SWISS IX | 344   | —     |
|        |        | EURO ST  | 1,785 | —     |
|        |        | SPI 200  | 516   | —     |
|        |        | FTSE100  | 833   | —     |

(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

(2018年5月14日現在)

| 項 目          | 当 期               |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>318,482,921 | %<br>93.7 |
| 投資証券         | 7,476,613         | 2.2       |
| コール・ローン等、その他 | 13,892,352        | 4.1       |
| 投資信託財産総額     | 339,851,886       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産(336,857,637千円)の投資信託財産総額(339,851,886千円)に対する比率は99.1%です。

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

|                    |                     |                    |                    |
|--------------------|---------------------|--------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=109.31円   | 1 カナダドル=85.55円      | 1 ユーロ=130.71円      | 1 イギリスポンド=148.27円  |
| 1 スイスフラン=109.44円   | 1 スウェーデンクローネ=12.72円 | 1 ノルウェークローネ=13.66円 | 1 デンマーククローネ=17.54円 |
| 1 オーストラリアドル=82.66円 | 1 ニュージーランドドル=76.25円 | 1 香港ドル=13.93円      | 1 シンガポールドル=82.00円  |
| 1 イスラエルシェゲル=30.56円 |                     |                    |                    |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月14日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 340,661,579,781  |
| コール・ローン等        | 9,996,112,537    |
| 株式(評価額)         | 318,482,921,497  |
| 投資証券(評価額)       | 7,476,613,390    |
| 未収入金            | 1,022,673,132    |
| 未収配当金           | 607,801,278      |
| 差入委託証拠金         | 3,075,457,947    |
| (B) 負債          | 3,434,997,934    |
| 未払金             | 2,734,955,904    |
| 未払解約金           | 700,040,647      |
| 未払利息            | 1,383            |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 337,226,581,847  |
| 元本              | 125,901,148,704  |
| 次期繰越損益金         | 211,325,433,143  |
| (D) 受益権総口数      | 125,901,148,704口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 26,785円          |

<注記事項>

- ①期首元本額 137,017,202,778円  
 期中追加設定元本額 97,435,796,357円  
 期中一部解約元本額 108,551,850,431円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2.6785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)

|                                  |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| ファンド・マネジャー(海外株式)                 | 256,744,004円    |
| eMAXIS 先進国株式インデックス               | 13,207,304,682円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)              | 1,265,449,206円  |
| eMAXIS バランス(波乗り型)                | 150,327,902円    |
| コアバランス                           | 353,091円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 7,829,583円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 10,971,321円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 10,448,458円     |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス          | 4,248,950,344円  |
| 海外株式セレクション(ラップ向け)                | 881,658,474円    |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)         | 540,570,125円    |
| つみたて先進国株式                        | 222,973,451円    |
| つみたて8資産均等バランス                    | 56,482,439円     |
| つみたて4資産均等バランス                    | 11,806,232円     |
| eMAXIS マイマネージャー1970s             | 892,051円        |
| eMAXIS マイマネージャー1980s             | 1,123,371円      |
| eMAXIS マイマネージャー1990s             | 1,482,934円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 542,499円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金) | 798,907円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金) | 880,017円        |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)          | 174,076,749円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)        | 21,988,649円     |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド           | 10,170,747,931円 |

○損益の状況 (2017年5月13日~2018年5月14日)

| 項 目                | 当 期              |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | 7,492,376,591    |
| 受取配当金              | 7,463,136,461    |
| 受取利息               | 28,953,646       |
| その他収益金             | 10,287,778       |
| 支払利息               | △ 10,001,294     |
| (B) 有価証券売買損益       | 23,703,938,865   |
| 売買益                | 52,531,814,707   |
| 売買損                | △ 28,827,875,842 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 1,761,145,493    |
| 取引益                | 3,169,319,468    |
| 取引損                | △ 1,408,173,975  |
| (D) 保管費用等          | △ 105,531,780    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 32,851,929,169   |
| (F) 前期繰越損益金        | 195,968,545,249  |
| (G) 追加信託差損益金       | 150,921,211,091  |
| (H) 解約差損益金         | △168,416,252,366 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 211,325,433,143  |
| 次期繰越損益金(I)         | 211,325,433,143  |

(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。

|  |                  |
|--|------------------|
| eMAXIS 全世界株式インデックス                         | 2,554,290,636円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)                 | 1,438,394,315円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)                 | 3,160,634,009円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)                | 339,439,938円     |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)            | 141,796,499円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)                 | 936,940,523円     |
| eMAXIS バランス (4資産均等型)                       | 85,785,632円      |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)                 | 20,160,015円      |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)                 | 33,770,168円      |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)                | 130,130,173円     |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフワード)                    | 97,449,207円      |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)                  | 301,804,367円     |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)             | 49,707,431円      |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)             | 11,486,389,204円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)           | 200,126,066円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)           | 2,001,979,404円   |
| MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)            | 45,132,671,767円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型 (適格機関投資家限定)           | 118,832,568円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)           | 59,554,989円      |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)             | 1,502,934,941円   |
| MSCI コクサイインデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)    | 3,139,833,268円   |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)           | 7,486,837,820円   |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)           | 38,467,093円      |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)          | 223,827,292円     |
| MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)  | 1,969,989,814円   |
| MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付) | 519,921,657円     |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)     | 223,443,871円     |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)                | 29,484,249円      |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)         | 1,349,756,321円   |
| MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)  | 28,176,923円      |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)          | 479,156,387円     |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド                       | 2,466,934,745円   |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA               | 2,199,430円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA             | 7,786,060円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA               | 9,797,630円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA               | 10,728,494円      |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA                     | 70,579,527円      |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)                | 18,765,275円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)                | 116,697,293円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)                | 24,269,943円      |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)                | 176,155,083円     |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド                   | 4,405,605,447円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)       | 170,634,950円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)     | 671,803,453円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)       | 646,810,861円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)       | 576,291,546円     |
| 合計   | 125,901,148,704円 |

[お知らせ]

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2017年8月16日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。  
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)  
(2018年1月1日)