

★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	
運用方針	投資成果をS&P500指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド
	S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド	イ. 米国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） ロ. 米国の企業のDR（預託証券） ハ. 米国株式の指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）
マザーファンドの運用方法	①主として、米国の株式（DRを含みます。）（※）に投資し、投資成果をS&P500指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ※効率性の観点から米国株式の指数との連動をめざすETFに投資する場合があります。 ②運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

iFree S & P 5 0 0 インデックス

運用報告書（全体版） 第1期 （決算日 2018年9月7日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「iFree S & P 5 0 0 インデックス」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9：00～17：00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S&P500指数 (円ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率						
1 期末(2018年9月7日)	円 11,843	円 0	% 18.4	円 11,720	% 17.2	% 91.0	% 2.2	% 4.2	% 2.5	百万円 5,725

(注1) S&P500指数 (円ベース) は、S&P500指数 (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。S&P500指数 (米ドルベース) の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

* ベンチマークはS&P500指数 (円ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期末：11,843円

騰落率：18.4%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じてベンチマーク (S&P500指数 (円ベース)) に連動させることをめざした運用を行なった結果、米国株式が上昇基調だったことからベンチマークが上昇し、当ファンドの基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基準 価 額		S&P500指数 (円ベース)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率					
(設定) 2017年 8月31日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -	% -	% -
8月末	10,000	0.0	10,000	0.0	-	-	-	-
9月末	10,401	4.0	10,427	4.3	69.3	11.7	19.7	2.1
10月末	10,708	7.1	10,729	7.3	67.0	5.0	27.9	2.0
11月末	10,839	8.4	10,843	8.4	56.7	3.6	38.9	1.7
12月末	11,194	11.9	11,191	11.9	49.8	4.8	40.0	1.4
2018年 1月末	11,327	13.3	11,315	13.2	91.6	3.6	2.7	2.4
2月末	10,889	8.9	10,858	8.6	80.0	4.0	15.0	2.1
3月末	10,381	3.8	10,339	3.4	69.2	2.7	26.9	1.9
4月末	10,798	8.0	10,747	7.5	62.1	2.8	33.9	1.7
5月末	10,984	9.8	10,911	9.1	56.6	2.2	39.7	1.5
6月末	11,146	11.5	11,065	10.6	54.6	2.5	41.7	1.5
7月末	11,560	15.6	11,465	14.6	52.4	2.3	43.9	1.4
8月末	11,992	19.9	11,873	18.7	92.3	2.3	3.0	2.5
(期末) 2018年 9月 7日	11,843	18.4	11,720	17.2	91.0	2.2	4.2	2.5

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2017.8.31~2018.9.7)

■米国株式市況

米国株式市況は、設定時から、好調な経済指標や企業業績を背景に堅調な展開となりました。2017年11月下旬以降も、米国の税制改革の進展により企業業績のさらなる上昇が見込まれたことから、米国株式市況は一段高となりました。しかし2018年2月に入ると、良好な雇用統計を受けて金利が急上昇したことから、株式市況は大幅に下落しました。3月から4月にかけては、IT（情報技術）関連企業の好決算や株式市況の大幅下落による割安感が強まったことによる反発はあったものの、金利上昇による景気悪化懸念も根強く、やや上値が重い展開となりました。その後は、貿易摩擦懸念という悪材料はあったものの、全体として好調な企業決算や対EU（欧州連合）との通商問題の進展、対メキシコではNAFTA（北米自由貿易協定）再交渉に関する2国間協議の合意などが好材料となり、米国株式市況は再び上昇基調で期末を迎えました。

■為替相場

米ドル円為替相場は、設定時から2017年10月にかけては、米国金利の上昇を受けて円安が進みました。しかし2018年に入ると、米国株式の急落や米国が保護主義的な政策を打ち出したことなどでリスク回避の動きが強まり、円高に転じました。4月以降は、対中国との貿易摩擦の激化がある程度織り込まれたことや、米国株式が再び上昇基調となったことでリスク回避の動きが弱まり、再び緩やかな円安となって期末を迎えました。

ポートフォリオについて

(2017.8.31~2018.9.7)

■当ファンド

「S & P 500インデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行ないました。

■S & P 500インデックス・マザーファンド

株式組入比率（DR（預託証券）、ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。以下同じ。）は、期を通じて原則として100%前後で運用を行ないました。

ポートフォリオ構築にあたっては、S&P500指数採用銘柄に投資し、S&P500指数に連動するETFも組み入れることにより、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行ないました。

また、効率性の観点からS&P500指数に連動する株価指数先物も利用しました。

ベンチマークとの差異について

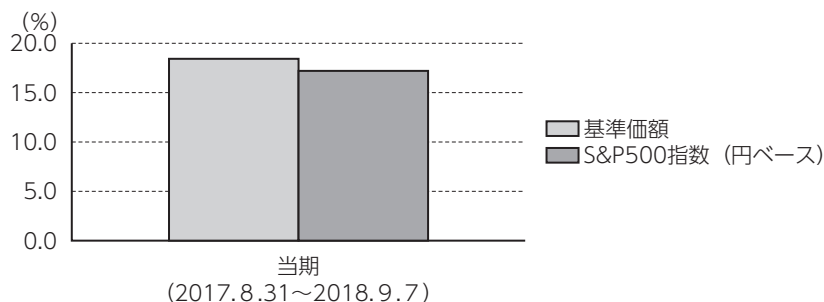
ベンチマークの騰落率は17.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.4%となりました。

マザーファンドの未収配当金部分等については株式の組み入れができないため、先物を利用することにより、期を通じて株式組入比率を基本的に100%前後で推移させました。その結果、ベンチマークの上昇に対し、組入比率によるかい離は設定翌営業日を除いてほぼ発生しませんでした。

また、配当金に対する課税分、信託報酬や保管費用等のコストが、マイナス要因となりました。

なお、組み入れている株式ポートフォリオ（D R、E T F、株価指数先物を含む。）とベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年8月31日 ～2018年9月7日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	1,843

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

主として「S & P 500インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■S & P 500インデックス・マザーファンド

主として、米国の株式（DRを含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。また、効率性の観点からS&P500指数との連動をめざすETFおよび先物にも投資します。なお、ETFおよび先物の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の50%程度以下に維持することを基本とします。

また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.8.31~2018.9.7)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	27円	0.248%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,992円です。
(投 信 会 社)	(15)	(0.132)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(10)	(0.088)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.028)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	3	0.030	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(2)	(0.017)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(1)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.003	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	11	0.099	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)	(8)	(0.077)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(2)	(0.017)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	42	0.380	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、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マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
S & P 500インデックス・マザーファンド	5,558,831	5,991,570	740,287	840,800

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

項 目	当 期
	S & P 500インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	5,084,935千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,411,067千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	2.10

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
500	-	500	-	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
S & P 500インデックス・マザーファンド	4,818,543	5,721,538

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9月7日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
S & P 500インデックス・マザーファンド	5,721,538	99.5
コール・ローン等、その他	25,890	0.5
投資信託財産総額	5,747,429	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.51円です。

(注3) S & P 500インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(5,642,381千円)の投資信託財産総額(5,746,755千円)に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年9月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,747,429,003円
コール・ローン等	25,890,608
S & P 500インデックス・マザーファンド(評価額)	5,721,538,395
(B) 負債	22,340,976
未払解約金	16,331,347
未払信託報酬	5,878,141
その他未払費用	131,488
(C) 純資産総額(A-B)	5,725,088,027
元本	4,834,041,184
次期繰越損益金	891,046,843
(D) 受益権総口数	4,834,041,184口
1万口当り基準価額(C/D)	11,843円

*設定時における元本額は500,000,000円、当期中における追加設定元本額は6,659,210,956円、同解約元本額は2,325,169,772円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,843円です。

■損益の状況

当期 自2017年8月31日 至2018年9月7日

項 目	当	期
(A) 配当等収益	△	5,384円
受取利息		1,918
支払利息	△	7,302
(B) 有価証券売買損益		441,499,312
売買益		564,274,706
売買損	△	122,775,394
(C) 信託報酬等	△	8,713,005
(D) 当期損益金(A + B + C)		432,780,923
(E) 追加信託差損益金		458,265,920
(配当等相当額)	(△	6,966)
(売買損益相当額)	(458,272,886)
(F) 合計(D + E)		891,046,843
次期繰越損益金(F)		891,046,843
追加信託差損益金		458,265,920
(配当等相当額)	(△	6,966)
(売買損益相当額)	(458,272,886)
分配準備積立金		432,786,307
繰越損益金	△	5,384

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益		0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		432,786,307
(c) 収益調整金		458,272,886
(d) 分配準備積立金		0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		891,059,193
(f) 分配金		0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		891,059,193
(h) 受益権総口数		4,834,041,184口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド

運用報告書 第 1 期 (決算日 2018年 9月 7日)

(計算期間 2017年 8月 31日～2018年 9月 7日)

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンドの第 1 期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	投資成果をS&P500指数 (円ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	イ. 米国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含み ます。) ロ. 米国の企業のDR (預託証券) ハ. 米国株式の指数との連動をめざすETF (上場投資信託証券)
運 用 方 法	①主として、米国の株式 (DRを含みます。) (※) に投資し、投資成果をS&P500指数 (円 ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ※効率性の観点から米国株式の指数との連動をめざすETFに投資する場合があります。 ②運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等 の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超え ることがあります。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
株 式 組 入 制 限	無制限

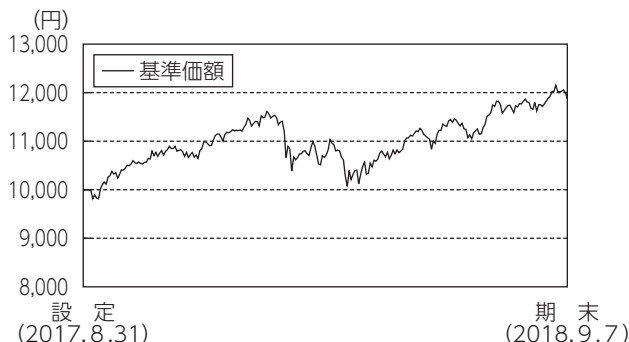
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目 9 番 1 号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		S&P500指数 (円ベース)		株式 組入比率		株式 先物比率		投資信託 受託証券 組入比率		投資信託 証券 組入比率	
	円	%	ベンチマーク	騰落率	%	%	%	%	%	%	%	%
設定2017年8月31日	10,000	0.0	10,000	0.0	—	—	—	—	—	—	—	—
8月末	10,000	0.0	10,000	0.0	—	—	—	—	—	—	—	—
9月末	10,403	4.0	10,427	4.3	69.3	11.7	19.7	2.1				
10月末	10,713	7.1	10,729	7.3	67.0	5.0	27.9	2.0				
11月末	10,846	8.5	10,843	8.4	56.7	3.6	38.9	1.7				
12月末	11,204	12.0	11,191	11.9	49.9	4.8	40.0	1.4				
2018年1月末	11,339	13.4	11,315	13.2	91.7	3.6	2.7	2.4				
2月末	10,903	9.0	10,858	8.6	80.0	4.0	15.0	2.1				
3月末	10,396	4.0	10,339	3.4	69.3	2.7	26.9	1.9				
4月末	10,816	8.2	10,747	7.5	62.1	2.8	33.9	1.7				
5月末	11,005	10.1	10,911	9.1	56.6	2.2	39.7	1.5				
6月末	11,169	11.7	11,065	10.6	54.6	2.5	41.7	1.5				
7月末	11,587	15.9	11,465	14.6	52.4	2.3	44.0	1.4				
8月末	12,023	20.2	11,873	18.7	92.4	2.3	3.0	2.5				
期末2018年9月7日	11,874	18.7	11,720	17.2	91.1	2.2	4.2	2.5				

(注1) 騰落率は設定比。
 (注2) S&P500指数(円ベース)は、S&P500指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。S&P500指数(米ドルベース)の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 (注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 期末：11,874円 騰落率：18.7%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク(S&P500指数(円ベース))に連動させることをめざした運用を行なった結果、米国株式が上昇基調だったことからベンチマークが上昇し、当ファンドの基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○米国株式市況

米国株式市況は、設定時から、好調な経済指標や企業業績を背景に堅調な展開となりました。2017年11月下旬以降も、米国の税制改革の進展により企業業績のさらなる上昇が見込まれたことから、米国株式市況は一段高となりました。しかし2018年2月に入ると、良好な雇用統計を受けて金利が急上昇したことから、株式市況は大幅に下落しました。3月から4月にかけては、IT(情報技術)関連企業的好決算や株式市況の大幅下落による割安感が強まったことによる反発はあったものの、金利上昇による景気悪化懸念も根強く、やや上値が重い展開となりました。その後は、貿易摩擦懸念という悪材料はあったものの、全体として好調な企業決算や対EU(欧州連合)との通商問題の進展、対メキシコではNAFTA(北米自由貿易協定)再交渉に関する2国間協議の合意などが好材料となり、米国株式市況は再び上昇基調で期末を迎えました。

○為替相場

米ドル円為替相場は、設定時から2017年10月にかけては、米国金利の上昇を受けて円安が進みました。しかし2018年に入ると、米国株式の急落や米国が保護主義的な政策を打ち出したことなどでリスク回避の動きが強まり、円高に転じました。4月以降は、対中国との貿易摩擦の激化がある程度織り込まれたことや、米国株式が再び上昇基調となったことでリスク回避の動きが弱まり、再び緩やかな円安となって期末を迎えました。

◆ポートフォリオについて

株式組入比率(DR(預託証券)、ETF(上場投資信託証券)、株価指数先物を含む。以下同じ。)、期を通じて原則として100%前後で運用を行ないました。

ポートフォリオ構築にあたっては、S&P500指数採用銘柄に投資し、S&P500指数に連動するETFも組み入れることにより、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行ないました。

また、効率性の観点からS&P500指数に連動する株価指数先物も利用しました。

◆ベンチマークとの差異について

当期の当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。

未取配当金部分等については株式の組み入れができないため、先物を利用することにより、期を通じて株式組入比率を基本的に100%前後で推移させました。その結果、ベンチマークの上昇に対し、組入比率によるかい離は設定翌営業日を除いてほぼ発生しませんでした。

また、配当金に対する課税分や保管費用等のコストがマイナス要因となりました。

なお、組み入れている株式ポートフォリオ(DR、ETF、株価指数先物を含む。)とベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

主として、米国の株式(DRを含む。)に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。また、効率性の観点からS&P500指数との連動をめざすETFおよび先物にも投資します。なお、ETFおよび先物の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の50%程度以下に維持することを基本とします。

また、保有外貨資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	3円 (2)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託受益証券)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	0 (0)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	10 (8)
(その他)	(2)
合計	14

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外国	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
アメリカ	5,611.05 (8.57)	45,725 (△ 135)	18.93	115

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)		9.938	209,852	21,116	APPLE INC (アメリカ)		0.173	3,611	20,872
MICROSOFT CORP (アメリカ)		15.27	163,912	10,734	KEURIG DR PEPPER INC (アメリカ)		0.203	2,749	13,541
AMAZON.COM INC (アメリカ)		0.801	138,818	173,306	ABBVIE INC (アメリカ)		0.083	913	11,005
FACEBOOK INC-A (アメリカ)		4.768	94,179	19,752	ACUITY BRANDS INC (アメリカ)		0.055	742	13,507
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)		3.827	86,483	22,598	WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC (アメリカ)		0.106	725	6,841
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)		6.764	82,048	12,130	CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)		0.124	606	4,890
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)		5.326	80,824	15,175	WYNDHAM DESTINATIONS INC (アメリカ)		0.106	573	5,414
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)		8.419	76,787	9,120	NVENT ELECTRIC PLC (アイルランド)		0.18	477	2,653
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)		0.603	76,521	126,900	RANGE RESOURCES CORP (アメリカ)		0.243	429	1,765
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		0.594	75,907	127,789	PINNACLE WEST CAPITAL (アメリカ)		0.043	420	9,775

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	165.04 (-)	44,151 (-)	157.49 (-)	44,616 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、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。

(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	17,461 (△ 0.397)	1,284 (△ 8)	0,239 (-)	4 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、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。

(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	1,899	1,788	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

当				期				
買		付		売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円		千口	千円	円
ISHARES CORE S&P 500 ETF (アメリカ)		165.04	4,871,885	29,519	ISHARES CORE S&P 500 ETF (アメリカ)	157.49	4,938,886	31,359

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2017年8月31日から2018年9月7日まで)

当				期				
買		付		売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円		千口	千円	円
AMERICAN TOWER CORP (アメリカ)		0.874	14,123	16,159	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A (アメリカ)	0.239	528	2,209
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		0.613	11,587	18,902				
CROWN CASTLE INTL CORP (アメリカ)		0.821	10,019	12,203				
PROLOGIS INC (アメリカ)		1.248	9,040	7,243				
EQUINIX INC (アメリカ)		0.157	7,649	48,725				
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		0.301	6,857	22,780				
WEYERHAEUSER CO (アメリカ)		1.504	5,804	3,859				
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		0.278	5,488	19,742				
WELLTOWER INC (アメリカ)		0.739	5,409	7,320				
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		0.414	5,409	13,065				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	柄	当		業	種	等
		株数	価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円			
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2.36	32	3,572	情報技術		
SYNCHRONY FINANCIAL	14.05	44	4,937	金融		
ABBOTT LABORATORIES	34.81	229	25,323	ヘルスケア		
ARCONIC INC	8.46	18	2,049	資本財・サービス		
VERISK ANALYTICS INC	3.13	37	4,161	資本財・サービス		
AMPHENOL CORP-CL A	5.99	57	6,323	情報技術		
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6.58	70	7,824	情報技術		
QORVO INC	2.51	18	2,083	情報技術		
AFLAC INC	15.34	71	7,948	金融		
DARDEN RESTAURANTS INC	2.44	28	3,203	一般消費財・サービス		
ADOBE SYSTEMS INC	9.83	255	28,216	情報技術		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4.62	23	2,601	素材		
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6.9	12	1,418	金融		
GARMIN LTD	2.21	15	1,685	一般消費財・サービス		
AETNA INC	6.47	131	14,487	ヘルスケア		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4.33	71	7,946	素材		
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	14.89	244	26,987	資本財・サービス		

銘柄	柄	当		業	種	等
		株数	価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額			
		千アメリカ・ドル	千円			
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3.25	32	3,554	情報技術		
AUTOZONE INC	0.5	38	4,263	一般消費財・サービス		
DOLLAR TREE INC	4.71	38	4,274	一般消費財・サービス		
PINNACLE WEST CAPITAL	2.24	17	1,985	公益事業		
DR HORTON INC	6.82	30	3,374	一般消費財・サービス		
DENTSPLY SIRONA INC	4.54	17	1,951	ヘルスケア		
AUTODESK INC	4.4	65	7,235	情報技術		
MOODY'S CORP	3.34	59	6,520	金融		
DEVON ENERGY CORP	10.4	42	4,669	エネルギー		
ALBEMARLE CORP	2.22	21	2,395	素材		
ALLIANT ENERGY CORP	4.62	20	2,239	公益事業		
CITIGROUP INC	50.7	355	39,281	金融		
AUTOMATIC DATA PROCESSING	8.71	128	14,176	情報技術		
AMERICAN ELECTRIC POWER	9.79	71	7,933	公益事業		
HESS CORP	5.2	32	3,618	エネルギー		
DAVITA INC	2.76	18	2,068	ヘルスケア		
DANAHER CORP	12.2	127	14,102	ヘルスケア		

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FORTIVE CORP	6.05	50	5,626	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	11.56	89	9,885	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3.42	6	771	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	3.76	7	796	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11.14	55	6,082	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	6.98	62	6,911	情報技術
APPLE INC	97.65	2,178	240,753	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6.91	53	5,935	金融
BOEING CO/THE	10.9	382	42,312	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2.99	23	2,565	金融
BECTON DICKINSON AND CO	5.3	135	14,974	ヘルスケア
NISOURCE INC	6.67	18	2,040	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2.74	26	2,943	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20.04	104	11,558	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	82.14	445	49,280	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	38.27	814	90,031	金融
ANSYS INC	1.66	30	3,396	情報技術
H&R BLOCK INC	4.19	11	1,225	一般消費財・サービス
BB&T CORP	15.46	80	8,926	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	32.52	198	21,900	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	67.64	771	85,288	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	4.84	54	6,057	金融
CIGNA CORP	4.83	89	9,884	ヘルスケア
LKQ CORP	6.18	20	2,302	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5.22	28	3,101	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	5.58	25	2,869	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2.92	41	4,620	金融
DOLLAR GENERAL CORP	5.1	56	6,262	一般消費財・サービス
CATERPILLAR INC	11.85	167	18,539	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	5.63	28	3,149	公益事業
MOSAIC CO/THE	6.95	21	2,325	素材
DELTA AIR LINES INC	12.86	72	8,021	資本財・サービス
CORNING INC	16.52	55	6,121	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	93.45	441	48,826	情報技術
MORGAN STANLEY	27.06	129	14,332	金融
MSCI INC	1.8	32	3,565	金融
COTY INC-CL A	9.39	11	1,276	生活必需品
BROADCOM INC	7.98	172	19,045	情報技術
DTE ENERGY COMPANY	3.61	41	4,547	公益事業
CENTENE CORP	4.07	59	6,535	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2.28	23	2,592	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	9.6	39	4,369	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3.6	26	2,938	金融
GARTNER INC	1.81	27	3,072	情報技術
DOMINION ENERGY INC	13.01	93	10,387	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	8.13	49	5,511	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	2.91	16	1,864	資本財・サービス
DEERE & CO	6.47	93	10,374	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	1.93	6	730	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	3.17	39	4,353	情報技術
NASDAQ INC	2.32	21	2,386	金融

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CONSOLIDATED EDISON INC	6.18	50	5,555	公益事業
HUNT (JB) TRANSP SVCS INC	1.72	21	2,339	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	17.29	115	12,801	生活必需品
AMETEK INC	4.61	36	3,988	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	4.89	28	3,140	生活必需品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6.37	71	7,901	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	8.67	205	22,676	生活必需品
SCANA CORP	1.98	7	802	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1.1	15	1,748	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.5	24	2,658	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6	13	1,537	金融
CUMMINS INC	3.04	42	4,733	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	15.15	109	12,047	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	1.07	34	3,789	金融
HANESBRANDS INC	7.18	12	1,401	一般消費財・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5.6	42	4,684	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	0.71	11	1,231	情報技術
COPART INC	4	26	2,877	資本財・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	1.43	53	5,860	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	0.93	32	3,635	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	6.7	17	1,922	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	37.72	66	7,365	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	5.52	73	8,070	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	8.93	19	2,162	エネルギー
COCA-COLA CO/THE	76.14	348	38,511	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	3.47	26	2,894	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	6.29	19	2,103	金融
CSX CORP	17.41	128	14,248	資本財・サービス
FLUOR CORP	2.83	15	1,763	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2.03	34	3,807	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	2.39	29	3,289	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	8.01	1,568	173,346	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	2.57	13	1,489	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4.21	59	6,539	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	84.19	677	74,858	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	2.76	17	1,923	情報技術
AES CORP	13.19	17	1,935	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	1.52	32	3,554	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	0.83	18	2,011	金融
EOG RESOURCES INC	11.5	132	14,678	エネルギー
EQT CORP	4.98	23	2,581	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3.44	25	2,823	情報技術
ABIOMED INC	0.8	30	3,386	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	3.27	28	3,193	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6.39	43	4,756	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	77.79	73	8,106	一般消費財・サービス
MACY'S INC	6.07	21	2,371	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	3.1	8	946	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC-C	6.76	17	1,899	一般消費財・サービス
NEXTERA ENERGY INC	9.36	162	17,979	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	26.82	36	4,021	素材

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
US BANCORP	31.02	168	18,624	金融
UNITED RENTALS INC	1.63	25	2,770	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	1.17	22	2,458	情報技術
FASTENAL CO	5.7	33	3,717	資本財・サービス
FISERV INC	8.18	65	7,265	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	172.56	215	23,856	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	3.23	21	2,355	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4.09	21	2,404	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	4.81	11	1,248	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	25.25	86	9,593	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	2.15	10	1,202	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	5.5	107	11,866	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7	164	18,141	金融
ALPHABET INC-CL A	5.94	703	77,720	情報技術
ALPHABET INC-CL C	6.03	706	78,061	情報技術
GENERAL MILLS INC	11.76	55	6,109	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	8.94	33	3,750	公益事業
GENUINE PARTS CO	2.95	29	3,300	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	7.05	38	4,271	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	13.59	40	4,430	金融
HARRIS CORP	2.33	37	4,158	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	8.26	31	3,512	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	17.44	64	7,104	エネルギー
HOME DEPOT INC	22.95	472	52,217	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	0.72	7	822	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21.92	35	3,958	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	0.84	20	2,303	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	2.79	29	3,213	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	3.35	14	1,631	一般消費財・サービス
HUMANA INC	2.78	92	10,257	ヘルスケア
HELMERICH & PAYNE	2.13	13	1,480	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	3.11	25	2,768	ヘルスケア
HP INC	32.62	80	8,896	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	30.39	50	5,548	情報技術
HOLLYFRONTIER CORP	3.48	25	2,769	エネルギー
KRAFT HEINZ CO/THE	11.85	67	7,438	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	16.99	248	27,485	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	8.23	42	4,713	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	2.94	15	1,751	資本財・サービス
ZOETIS INC	9.6	86	9,520	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	4.94	50	5,526	資本財・サービス
ALLEGION PLC	1.93	17	1,896	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	2.63	11	1,324	一般消費財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	6.9	19	2,112	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	2.26	24	2,741	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	53.26	728	80,558	ヘルスケア
ABBVIE INC	30.09	282	31,170	ヘルスケア
HOLOGIC INC	5.38	20	2,303	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	6.93	80	8,887	生活必需品
KROGER CO	16.16	52	5,814	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	3.09	33	3,663	情報技術

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LOCKHEED MARTIN CORP	4.94	162	17,955	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1.82	39	4,347	情報技術
L BRANDS INC	4.84	12	1,420	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	16.36	178	19,775	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	18.97	199	22,089	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	3.3	52	5,836	情報技術
LOEWS CORP	5.23	26	2,883	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	4.35	28	3,141	金融
MCDONALD'S CORP	15.58	255	28,191	一般消費財・サービス
3M CO	11.83	251	27,812	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	47.68	774	85,638	情報技術
S&P GLOBAL INC	5.01	103	11,461	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1.24	24	2,717	素材
CONCHO RESOURCES INC	3.74	49	5,486	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE CORP	2.36	10	1,183	ヘルスケア
PHILLIPS 66	8.39	97	10,820	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	8.62	24	2,715	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9.92	26	2,959	一般消費財・サービス
MATTEL INC	6.84	10	1,158	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	5.66	51	5,681	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2.41	31	3,450	生活必需品
MYLAN NV	10.22	39	4,396	ヘルスケア
METLIFE INC	20.17	92	10,215	金融
ARISTA NETWORKS INC	0.9	24	2,663	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3.22	41	4,540	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.51	29	3,313	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	8.32	25	2,849	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	2.47	44	4,970	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2.4	9	1,066	金融
MERCK & CO. INC.	53.47	370	40,996	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	46.13	323	35,725	素材
MASCO CORP	6.19	23	2,593	資本財・サービス
M & T BANK CORP	2.89	51	5,705	金融
MARSH & MCLENNAN COS	10.06	85	9,487	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	5.87	73	8,107	一般消費財・サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3.01	21	2,421	一般消費財・サービス
NETAPP INC	5.32	44	4,903	情報技術
NIKE INC -CL B	25.48	204	22,638	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	5.62	98	10,844	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4.63	38	4,292	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2.61	23	2,648	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	3.49	105	11,635	資本財・サービス
APTIV PLC	5.26	44	4,928	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	10.59	32	3,538	素材
MCKESSON CORP	4.06	50	5,630	ヘルスケア
XYLEM INC	3.56	27	3,084	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	30.89	242	26,838	生活必需品
NUCOR CORP	6.3	39	4,407	素材
WESTERN UNION CO	9.11	17	1,908	情報技術
NEWELL BRANDS INC	9.68	20	2,275	一般消費財・サービス
EVERGY INC	5.37	31	3,498	公益事業

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15.25	118	13,072	エネルギー
PAYCHEX INC	6.36	47	5,243	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1.65	56	6,285	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	37.65	228	25,292	生活必需品
P G & E CORP	10.26	46	5,162	公益事業
PFIZER INC	116.3	485	53,696	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	10.12	49	5,512	公益事業
STRYKER CORP	6.37	109	12,055	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	2.64	46	5,188	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3.38	55	6,149	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	49.98	413	45,649	生活必需品
EXELON CORP	19.22	85	9,422	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4.42	51	5,734	ヘルスケア
CONOCOPHILLIPS	23.29	164	18,155	エネルギー
PEPSICO INC	28.17	319	35,333	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8.3	81	9,055	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3.55	31	3,495	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	12.74	215	23,844	情報技術
PENTAIR PLC	3.2	13	1,537	資本財・サービス
QUALCOMM INC	29.48	207	22,922	情報技術
INVESCO LTD	8.14	19	2,178	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	1.48	24	2,734	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5.32	29	3,275	金融
RAYTHEON COMPANY	5.75	116	12,849	資本財・サービス
RED HAT INC	3.57	52	5,757	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	1.57	62	6,904	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	4.46	33	3,666	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	0.93	177	19,624	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	7.51	73	8,079	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	1.89	21	2,330	素材
RESMED INC	2.84	31	3,512	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	2.73	29	3,311	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	2.5	18	2,081	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	1.13	14	1,636	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	2.24	21	2,337	ヘルスケア
ROCKWELL COLLINS INC	3.3	45	5,069	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	22.36	43	4,838	金融
CHEVRON CORP	37.99	437	48,376	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	6.47	43	4,824	公益事業
SYMANTEC CORP	12.36	24	2,705	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	3.06	43	4,765	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	2.96	30	3,329	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	3.71	113	12,512	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	6.01	28	3,113	不動産
TWITTER INC	13.03	40	4,436	情報技術
SOUTHERN CO/THE	20.12	92	10,174	公益事業
SYSCO CORP	9.52	71	7,887	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	5.33	70	7,808	金融
STERICYCLE INC	1.68	10	1,150	資本財・サービス
SCHLUMBERGER LTD	27.56	165	18,337	エネルギー
AT&T INC	144.33	464	51,326	電気通信サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SOUTHWEST AIRLINES CO	10.56	64	7,122	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1.64	75	8,380	素材
SEMPRA ENERGY	5.27	62	6,873	公益事業
TIFFANY & CO	2.03	25	2,767	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	5.71	28	3,116	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	19.43	215	23,810	情報技術
SALESFORCE.COM INC	14.06	209	23,124	情報技術
WESTROCK CO	5.14	28	3,117	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18.39	71	7,891	資本財・サービス
ANDEAVOR	2.48	43	4,759	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	15.43	238	26,370	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	16.96	34	3,815	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	9.14	75	8,363	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	14.74	196	21,749	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	13.66	168	18,673	資本財・サービス
UNUM GROUP	4.43	16	1,794	金融
IQVIA HOLDINGS INC	3.17	40	4,444	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	4.8	31	3,480	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	19.13	515	57,005	ヘルスケア
VERISIGN INC	1.86	29	3,250	情報技術
VALERO ENERGY CORP	8.58	99	11,005	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	1.1	30	3,350	一般消費財・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1.69	21	2,366	ヘルスケア
ANTHEM INC	5.12	138	15,327	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	29.58	326	36,042	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	87.12	504	55,772	金融
FOOT LOCKER INC	1.52	7	808	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	7.93	72	8,051	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	23.58	67	7,426	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2.46	22	2,444	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	1.29	16	1,802	一般消費財・サービス
WALMART INC	28.72	277	30,611	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4.07	50	5,557	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	1.69	21	2,387	一般消費財・サービス
XEROX CORP	4.24	11	1,266	情報技術
TJX COMPANIES INC	12.46	137	15,229	一般消費財・サービス
WATERS CORP	1.51	28	3,199	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	4.72	41	4,544	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	6.76	128	14,231	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	16.93	115	12,727	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2.62	39	4,330	金融
WESTERN DIGITAL CORP	5.93	34	3,787	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	6.26	43	4,793	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10	53	5,865	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	35.52	513	56,720	情報技術
PPL CORP	13.92	43	4,756	公益事業
PULTEGROUP INC	5.21	14	1,616	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	4.95	55	6,126	素材
NORTHERN TRUST CORP	4.22	44	4,949	金融
NVIDIA CORP	12.04	328	36,286	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9.3	133	14,717	金融

S & P 500インデックス・マザーファンド

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TYSON FOODS INC-CL A	5.94	37	4,140	生活必需品
NETFLIX INC	8.6	297	32,927	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7.95	187	20,710	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	5.9	20	2,280	公益事業
TORCHMARK CORP	2.07	18	2,027	金融
TEXTRON INC	5.12	35	3,938	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	20.93	94	10,487	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	8.74	39	4,334	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS B	0.23	0	33	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	7.63	9	1,070	一般消費財・サービス
OMNICOM GROUP	4.52	31	3,459	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	59.2	282	31,212	情報技術
MASTERCARD INC - A	18.2	387	42,794	情報技術
ONEOK INC	8.2	54	5,981	エネルギー
CENTURYLINK INC	19.56	43	4,755	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	2.02	61	6,766	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	6.45	56	6,266	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2.23	29	3,212	情報技術
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	0.92	21	2,419	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO-B	3.7	24	2,715	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	9.64	28	3,125	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	187.37	578	63,878	金融
NORDSTROM INC	2.36	15	1,698	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	14.19	149	16,528	金融
ANALOG DEVICES INC	7.33	71	7,864	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	16.38	45	5,039	情報技術
ALASKA AIR GROUP INC	2.48	16	1,837	資本財・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17.86	96	10,638	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	10.28	65	7,234	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3.6	31	3,527	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3.34	41	4,578	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	2.62	6	771	エネルギー
AVERY DENNISON CORP	1.7	17	1,975	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11.69	88	9,781	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	12.57	95	10,586	資本財・サービス
AOI PLC	4.87	73	8,095	金融
AMGEN INC	13.2	258	28,613	ヘルスケア
TAPESTRY INC	5.7	28	3,147	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	8.69	73	8,131	資本財・サービス
CELGENE CORP	14	125	13,907	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3.38	70	7,792	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	20.03	80	8,913	情報技術
CIMAREX ENERGY CO	1.87	15	1,766	エネルギー
CME GROUP INC	6.81	118	13,057	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	7.64	34	3,804	エネルギー
ECOLAB INC	5.17	79	8,752	素材
EQUIFAX INC	2.35	31	3,525	資本財・サービス
GAP INC/THE	4.29	12	1,375	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	25.89	188	20,851	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	5.33	22	2,431	生活必需品
STATE STREET CORP	7.25	62	6,923	金融

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SUNTRUST BANKS INC	9.23	68	7,569	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	23.82	117	13,032	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	9.79	72	8,062	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	3.79	15	1,677	生活必需品
CARDINAL HEALTH INC	6.2	32	3,570	ヘルスケア
FEDEX CORP	4.85	119	13,195	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9.64	94	10,456	金融
FMC CORP	2.64	21	2,419	素材
CERNER CORP	6.27	40	4,496	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1.59	20	2,282	素材
CITRIX SYSTEMS INC	2.53	28	3,139	情報技術
INTEL CORP	92.66	437	48,393	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7.63	17	1,905	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7.12	35	3,924	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	6.04	85	9,416	資本財・サービス
ILLUMINA INC	2.91	101	11,200	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	3.22	13	1,441	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	2.23	120	13,353	ヘルスケア
SNAP-ON INC	1.1	19	2,205	資本財・サービス
CARMAX INC	3.54	27	3,060	一般消費財・サービス
COMERICA INC	3.45	33	3,731	金融
DUKE ENERGY CORP	13.93	116	12,849	公益事業
TARGET CORP	10.61	94	10,421	一般消費財・サービス
DOVER CORP	3.12	26	2,976	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	1.02	36	3,980	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2.41	17	1,966	資本財・サービス
CINTAS CORP	1.7	36	4,065	資本財・サービス
CA INC	6.2	27	3,004	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	7.83	28	3,136	生活必需品
CLOROX COMPANY	2.55	38	4,219	生活必需品
ENTERGY CORP	3.62	30	3,421	公益事業
MICROSOFT CORP	152.7	1,660	183,497	情報技術
INCYTE CORP	3.54	25	2,824	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	20.21	153	16,989	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	26.95	260	28,737	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	23.07	103	11,383	情報技術
BLACKROCK INC	2.45	115	12,778	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	8.55	24	2,730	公益事業
HASBRO INC	2.28	23	2,545	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	4.98	36	4,053	生活必需品
KEYCORP	21.11	44	4,941	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	2	23	2,622	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	29.29	127	14,077	生活必需品
KOHL'S CORP	3.35	27	3,000	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	0.99	25	2,842	ヘルスケア
APACHE CORP	7.63	32	3,597	エネルギー
CHUBB LTD	9.22	126	13,993	金融
ALLSTATE CORP	6.99	70	7,809	金融
EBAY INC	18.4	61	6,844	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	22.18	197	21,814	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	2.83	27	3,047	素材

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
XILINX INC	5.04	39	4,346	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	11.18	100	11,147	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	4.53	15	1,728	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION	3.96	21	2,333	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4.49	62	6,881	生活必需品
LENNAR CORP-A	5.42	28	3,134	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	5.24	29	3,209	金融
PROGRESSIVE CORP	11.6	79	8,822	金融
PRAXAIR INC	5.72	89	9,903	素材
PACCAR INC	7.02	48	5,366	資本財・サービス
PVH CORP	1.53	20	2,306	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	4.2	143	15,843	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	1.73	42	4,669	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	27.45	148	16,444	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	2.58	19	2,166	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	6.34	40	4,449	公益事業
INTUIT INC	4.85	106	11,783	情報技術
BORGWARNER INC	3.93	17	1,918	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	4.84	38	4,237	一般消費財・サービス
BALL CORP	6.99	29	3,255	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	27.46	98	10,921	ヘルスケア
XL GROUP LTD	5.16	29	3,260	金融
ELECTRONIC ARTS INC	6.05	68	7,568	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	2.61	28	3,179	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5.06	91	10,068	ヘルスケア
VF CORP	6.5	59	6,557	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	6.78	37	4,092	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	6.98	20	2,256	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	1.25	23	2,634	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1.81	19	2,181	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	8.08	49	5,512	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	91.27	327	36,229	一般消費財・サービス
ファンド合計	株数、金額 総資産<比率>	5,600.69 47.4銘柄	5,211,685 <91.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託受益証券

銘柄	株数	期末	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)			
ISHARES CORE S&P 500 ETF	7.55	2,191	242,220
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	7.55 1銘柄	2,191 <4.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	株数	期末	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.278	51	5,660
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.613	113	12,499
BOSTON PROPERTIES INC	0.302	39	4,334
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	0.314	13	1,521
VORNADO REALTY TRUST	0.343	26	2,884
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.232	36	4,052
EQUITY RESIDENTIAL	0.728	49	5,469
EQUINIX INC	0.157	67	7,489
AMERICAN TOWER CORP	0.874	129	14,303
HOST HOTELS & RESORTS INC	1.469	31	3,452
KIMCO REALTY CORP	0.846	14	1,634
VENTAS INC	0.712	42	4,730
WEYERHAEUSER CO	1.504	51	5,740
CROWN CASTLE INTL CORP	0.821	93	10,373
IRON MOUNTAIN INC	0.555	20	2,224
PROLOGIS INC	1.248	83	9,265
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.208	26	2,956
DUKE REALTY CORP	0.707	20	2,229
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.129	31	3,511
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.144	18	2,088
WELLTOWER INC	0.739	49	5,509
HCP INC	0.93	25	2,772
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.225	23	2,577
MACERICH CO/THE	0.219	12	1,384
REALTY INCOME CORP	0.569	33	3,696
PUBLIC STORAGE	0.301	64	7,143
REGENCY CENTERS CORP	0.292	19	2,141
SL GREEN REALTY CORP	0.177	18	2,014
UDR INC	0.529	21	2,345
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.414	51	5,682
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.246	22	2,520
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	16.825 31銘柄	144,212 <2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
外国	百万円	百万円
S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	127	-

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	5,211,685	90.7
投資信託受益証券	242,220	4.2
投資信託証券	144,212	2.5
コール・ローン等、その他	148,637	2.6
投資信託財産総額	5,746,755	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝110.51円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(5,642,381千円)の投資信託財産総額(5,746,755千円)に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年9月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,830,402,409円
コール・ローン等	109,186,701
株式(評価額)	5,211,685,406
投資信託受益証券(評価額)	242,220,294
投資信託証券(評価額)	144,212,368
未収入金	88,678,315
未収配当金	5,876,947
差入委託証拠金	28,542,378
(B) 負債	108,997,438
未払金	108,995,091
その他未払費用	2,347
(C) 純資産総額(A - B)	5,721,404,971
元本	4,818,543,368
次期繰越損益金	902,861,603
(D) 受益権総口数	4,818,543,368口
1万口当り基準価額(C/D)	11,874円

*設定時における元本額は499,800,000円、当期中における追加設定元本額は5,059,031,235円、同解約元本額は740,287,867円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、iFree S & P 5 0 0 インデックス4,818,543,368円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,874円です。

■損益の状況

当期 自2017年8月31日 至2018年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	56,960,042円
受取配当金	56,665,452
受取利息	155,326
その他収益金	179,337
支払利息	△ 40,073
(B) 有価証券売買損益	496,394,642
売買益	621,632,492
売買損	△125,237,850
(C) 先物取引等損益	20,391,692
取引益	32,803,678
取引損	△ 12,411,986
(D) その他費用	△ 3,111,405
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	570,634,971
(F) 解約差損益金	△100,512,133
(G) 追加信託差損益金	432,738,765
(H) 合計(E + F + G)	902,861,603
次期繰越損益金(H)	902,861,603

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。