

# 野村外国株インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

## 運用報告書(全体版)

第1期(決算日2016年12月6日)

作成対象期間(2016年8月25日～2016年12月6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。  
当作成対象期間の運用状況等について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。

●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   | 2016年8月25日以降、無期限とします。                                                                                                                                                   |                                                |  |
| 運用方針   | 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として外国の株式に実質的に投資し、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。<br>為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として行いません。 |                                                |  |
| 主な投資対象 | 野村外国株インデックス<br>Aコース<br>（野村SMA・EW向け）                                                                                                                                     | マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。   |  |
|        | マザーファンド                                                                                                                                                                 | 外国の株式を主要投資対象とします。                              |  |
| 主な投資制限 | 野村外国株インデックス<br>Aコース<br>（野村SMA・EW向け）                                                                                                                                     | 株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 |  |
|        | マザーファンド                                                                                                                                                                 | 株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。     |  |
| 分配方針   | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。                                                                 |                                                |  |

### 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104  
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

| 決 算 期             | 基 準 価 額 |              |         | ベンチマーク<br>MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・為替ヘッジあり) |         | 株<br>組 入 比 率 | 株<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-------------------|---------|--------------|---------|--------------------------------------------|---------|--------------|--------------|----------------------|--------------|
|                   | (分配落)   | 税 込 分<br>配 金 | 期 騰 落 率 |                                            | 期 騰 落 率 |              |              |                      |              |
| (設定日)             | 円       | 円            | %       |                                            | %       | %            | %            | %                    | 百万円          |
| 2016年 8 月 25 日    | 10,000  | —            | —       | 100.00                                     | —       | —            | —            | —                    | 1            |
| 1 期(2016年12月 6 日) | 10,102  | 5            | 1.1     | 101.24                                     | 1.2     | 95.3         | 2.3          | 2.6                  | 18           |

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。  
\* 当ファンドはマザーファンド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。  
\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI円ヘッジ指数（円ベース）を使用しております。なお、設定時を100として再指数化しています。  
\* MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。同指数の著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。  
(出所) MSCI

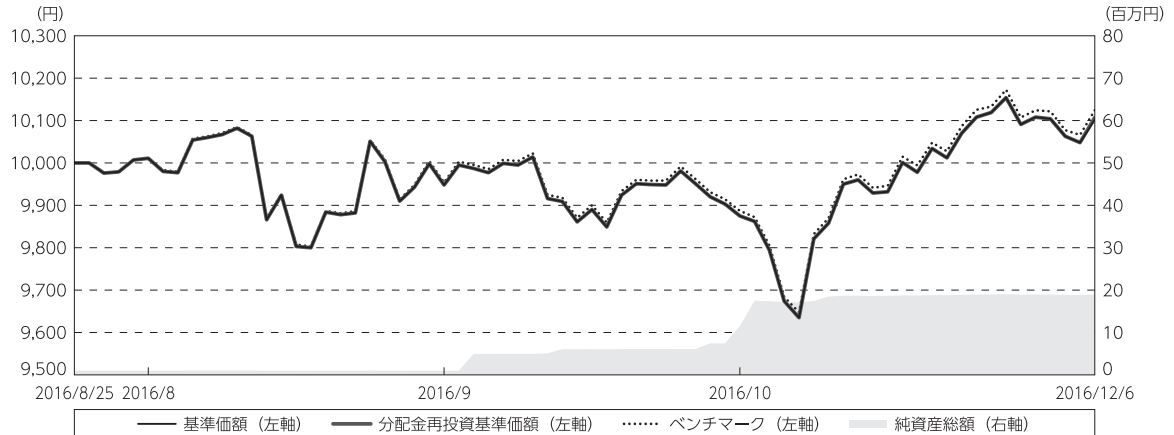
○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日          | 基 準 価 額 |       | ベンチマーク<br>MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・為替ヘッジあり) |       | 株<br>組 入 比 率 | 株<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 |
|----------------|---------|-------|--------------------------------------------|-------|--------------|--------------|----------------------|
|                |         | 騰 落 率 |                                            | 騰 落 率 |              |              |                      |
| (設定日)          | 円       | %     |                                            | %     | %            | %            | %                    |
| 2016年 8 月 25 日 | 10,000  | —     | 100.00                                     | —     | —            | —            | —                    |
| 8 月 末          | 10,011  | 0.1   | 100.10                                     | 0.1   | 94.9         | 1.9          | 2.8                  |
| 9 月 末          | 9,948   | △0.5  | 99.54                                      | △0.5  | 92.8         | 2.1          | 2.7                  |
| 10月 末          | 9,875   | △1.3  | 98.87                                      | △1.1  | 96.5         | 5.1          | 2.6                  |
| 11月 末          | 10,108  | 1.1   | 101.24                                     | 1.2   | 102.7        | 1.2          | 2.7                  |
| (期 末)          |         |       |                                            |       |              |              |                      |
| 2016年12月 6 日   | 10,107  | 1.1   | 101.24                                     | 1.2   | 95.3         | 2.3          | 2.6                  |

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。  
\* 当ファンドはマザーファンド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。  
\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：10,102円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率： 1.1%（分配金再投資ベース）

- （注）分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- （注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- （注）ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）です。ベンチマークは、設定時を10,000として計算しております。
- （注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から期末10,107円（分配金込み）に107円の値上がりとなりました。

米国次期政権の景気刺激策への期待感や市場予想を上回る経済指標の発表などを受け、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

設定時から2016年10月下旬にかけては、ECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を見送ったことや、欧州金融大手の業績悪化懸念などを受け、株式市場は上値が抑えられる中、米国の利上げ観測や米大統領選の行方を巡り一進一退の展開となりました。

11月以降は、米大統領選を巡る不透明感などを受け下落した後、米国次期政権の景気刺激策への期待感や市場予想を上回る経済指標の発表などを受け、上昇に転じました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### 〔野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）〕

主要投資対象である〔外国株式為替ヘッジ型マザーファンド〕受益証券に、期を通じてほぼ全額を投資しました。

### 〔外国株式為替ヘッジ型マザーファンド〕

#### ・株式組入比率

株式（投資信託証券や先物を含む）組入比率は、期を通じて概ねベンチマーク（MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり））の株式比率と同等に維持しました。

#### ・期中の主な動き

ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がベンチマークの中で占める比率にほぼ一致させ、ベンチマークの変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、資金流入出に対しても速やかに対応しました。

#### ・為替ヘッジ

為替ヘッジ（為替の売り予約）を行い、為替の送金などを含んだ外貨建て資産の実質組入比率を期を通じて概ねベンチマークの外貨比率と同等に維持しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

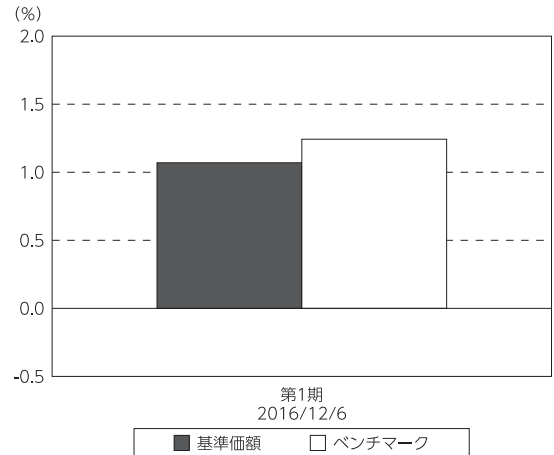
今期の基準価額の騰落率は+1.1%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の+1.2%を0.1ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（当ファンドの信託報酬や、マザーファンドにおける売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注）ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）です。

## ◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目       | 第 1 期                     |
|-----------|---------------------------|
|           | 2016年8月25日～<br>2016年12月6日 |
| 当期分配金     | 5                         |
| （対基準価額比率） | 0.049%                    |
| 当期の収益     | 5                         |
| 当期の収益以外   | —                         |
| 翌期繰越分配対象額 | 197                       |

（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

### 〔野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）〕

主要投資対象である〔外国株式為替ヘッジ型マザーファンド〕受益証券を高位に組み入れ、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果をめざします。

### 〔外国株式為替ヘッジ型マザーファンド〕

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2016年 8 月25日～2016年12月 6 日）

| 項 目                  | 当 期     |             | 項 目 の 概 要                                                              |
|----------------------|---------|-------------|------------------------------------------------------------------------|
|                      | 金 額     | 比 率         |                                                                        |
| (a) 信 託 報 酬          | 円<br>12 | %<br>0.117  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                                               |
| （ 投 信 会 社 ）          | （ 9 ）   | （ 0.092 ）   | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等                             |
| （ 販 売 会 社 ）          | （ 2 ）   | （ 0.015 ）   | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等                           |
| （ 受 託 会 社 ）          | （ 1 ）   | （ 0.009 ）   | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等                                            |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料    | 1       | 0.010       | (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>※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 ）              | （ 1 ）   | （ 0.008 ）   |                                                                        |
| （ 投 資 信 託 証 券 ）      | （ 0 ）   | （ 0.000 ）   |                                                                        |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）  | （ 0 ）   | （ 0.001 ）   |                                                                        |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税    | 1       | 0.007       | (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 ）              | （ 1 ）   | （ 0.006 ）   |                                                                        |
| （ 投 資 信 託 証 券 ）      | （ 0 ）   | （ 0.000 ）   |                                                                        |
| (d) そ の 他 費 用        | 0       | 0.001       | (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 ）          | （ 1 ）   | （ 0.007 ）   | 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及び資金の送金・資産の移転等に要する費用                      |
| （ 監 査 費 用 ）          | （ 0 ）   | （ 0.001 ）   | 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 ）            | （ △ 1 ） | （ △ 0.007 ） | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                                     |
| 合 計                  | 14      | 0.135       |                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、9,985円です。 |         |             |                                                                        |

\* 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。

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 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、当ファンドに対応するものを含みます。

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

## ○売買及び取引の状況

(2016年8月25日～2016年12月6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 |
|                   | 千口     | 千円     | 千口  | 千円  |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド | 12,612 | 18,605 | 12  | 18  |

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年8月25日～2016年12月6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               |
|---------------------|-------------------|
|                     | 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 6,887,760千円       |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 36,381,361千円      |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.18              |

\*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年8月25日～2016年12月6日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）&gt;

該当事項はございません。

## &lt;外国株式為替ヘッジ型マザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |           |                    |               |
|        | 百万円       | 百万円                | %             | 百万円       | 百万円                | %             |
| 為替先物取引 | 180,568   | 85                 | 0.0           | 180,761   | 1,189              | 0.7           |
| 為替直物取引 | 2,391     | 1,307              | 54.7          | 3,889     | 86                 | 2.2           |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2016年8月25日～2016年12月6日)

| 設定時残高<br>(元 本) | 当期設定<br>元 本 | 当期解約<br>元 本 | 期末残高<br>(元 本) | 取 引 の 理 由   |
|----------------|-------------|-------------|---------------|-------------|
| 百万円<br>1       | 百万円<br>－    | 百万円<br>－    | 百万円<br>1      | 当初設定時における取得 |

○組入資産の明細

(2016年12月6日現在)

親投資信託残高

| 銘                 | 柄 | 当 期 末        |              |
|-------------------|---|--------------|--------------|
|                   |   | 口 数          | 評 価 額        |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド |   | 千口<br>12,600 | 千円<br>18,949 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年12月6日現在)

| 項 目               | 当 期 末        |           |
|-------------------|--------------|-----------|
|                   | 評 価 額        | 比 率       |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド | 千円<br>18,949 | %<br>99.9 |
| コール・ローン等、その他      | 21           | 0.1       |
| 投資信託財産総額          | 18,970       | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国株式為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（39,020,934千円）の投資信託財産総額（39,646,679千円）に対する比率は98.4%です。

\*外貨建て資産は、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。1米ドル＝113.58円、1カナダドル＝85.57円、1英ポンド＝144.54円、1スイスフラン＝112.77円、1スウェーデンクローナ＝12.44円、1ノルウェークローネ＝13.54円、1デンマーククローネ＝16.41円、1ユーロ＝122.10円、1香港ドル＝14.65円、1シンガポールドル＝80.09円、1豪ドル＝84.67円、1ニュージーランドドル＝81.22円、1新シェケル＝29.79円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年12月6日現在）

| 項 目                    | 当 期 末       |
|------------------------|-------------|
|                        | 円           |
| (A) 資産                 | 18,970,159  |
| コール・ローン等               | 10,741      |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド(評価額) | 18,949,194  |
| 未収入金                   | 10,224      |
| (B) 負債                 | 19,079      |
| 未払収益分配金                | 9,379       |
| 未払信託報酬                 | 9,610       |
| その他未払費用                | 90          |
| (C) 純資産総額(A－B)         | 18,951,080  |
| 元本                     | 18,759,379  |
| 次期繰越損益金                | 191,701     |
| (D) 受益権総口数             | 18,759,379口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)        | 10,102円     |

(注) 期首元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は17,759,379円、期中一部解約元本額は0円、1口当たり純資産額は1.0102円です。

## ○損益の状況（2016年8月25日～2016年12月6日）

| 項 目              | 当 期        |
|------------------|------------|
|                  | 円          |
| (A) 配当等収益        | △ 1        |
| 支払利息             | △ 1        |
| (B) 有価証券売買損益     | 362,289    |
| 売買益              | 364,327    |
| 売買損              | △ 2,038    |
| (C) 信託報酬等        | △ 9,700    |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 352,588    |
| (E) 追加信託差損益金     | △151,508   |
| (配当等相当額)         | (△ 17)     |
| (売買損益相当額)        | (△151,491) |
| (F) 計(D＋E)       | 201,080    |
| (G) 収益分配金        | △ 9,379    |
| 次期繰越損益金(F＋G)     | 191,701    |
| 追加信託差損益金         | △151,508   |
| (配当等相当額)         | ( 27,969)  |
| (売買損益相当額)        | (△179,477) |
| 分配準備積立金          | 343,209    |

\*損益の状況の中で(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。

\*損益の状況の中で(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。

\*損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2016年8月25日～2016年12月6日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                       |
|------------------------------|---------------------------|
|                              | 2016年8月25日～<br>2016年12月6日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 58,433円                   |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 294,155円                  |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 27,969円                   |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 0円                        |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)           | 380,557円                  |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 202円                      |
| g. 分配金                       | 9,379円                    |
| h. 分配金(1万口当たり)               | 5円                        |

## ○分配金のお知らせ

---

|                 |    |
|-----------------|----|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|-----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年12月6日現在）

## &lt;外国株式為替ヘッジ型マザーファンド&gt;

下記は、外国株式為替ヘッジ型マザーファンド全体(26,274,484千口)の内容です。

## 外国株式

| 銘柄                          | 株数  | 当期末   |         | 業種等                     |
|-----------------------------|-----|-------|---------|-------------------------|
|                             |     | 評価額   |         |                         |
|                             |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                      | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                         |
| AFLAC INC                   | 45  | 309   | 35,108  | 保険                      |
| AGCO CORP                   | 7   | 44    | 5,027   | 機械                      |
| AES CORP                    | 91  | 103   | 11,720  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AT & T INC                  | 691 | 2,669 | 303,182 | 各種電気通信サービス              |
| ABBOTT LABORATORIES         | 165 | 634   | 72,020  | ヘルスケア機器・用品              |
| ABBVIE INC                  | 184 | 1,119 | 127,189 | バイオテクノロジー               |
| ACTIVISION BLIZZARD INC     | 71  | 259   | 29,418  | ソフトウェア                  |
| ACUITY BRANDS INC           | 4   | 111   | 12,609  | 電気設備                    |
| ADOBE SYSTEMS INC.          | 55  | 568   | 64,613  | ソフトウェア                  |
| ADVANCE AUTO PARTS          | 7   | 129   | 14,720  | 専門小売り                   |
| AETNA INC                   | 39  | 507   | 57,635  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP   | 6   | 91    | 10,391  | 資本市場                    |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC    | 34  | 151   | 17,196  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AIR PRODUCTS                | 22  | 332   | 37,818  | 化学                      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES         | 18  | 115   | 13,147  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ALBEMARLE CORP              | 14  | 126   | 14,405  | 化学                      |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 24  | 307   | 34,906  | バイオテクノロジー               |
| ALIGN TECHNOLOGY INC        | 8   | 78    | 8,862   | ヘルスケア機器・用品              |
| ALLEGHANY CORP              | 1   | 98    | 11,146  | 保険                      |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP  | 6   | 151   | 17,253  | 情報技術サービス                |
| ALLIANT ENERGY CORP         | 29  | 106   | 12,044  | 電力                      |
| ALLSTATE CORP               | 41  | 288   | 32,765  | 保険                      |
| ALLY FINANCIAL INC          | 42  | 82    | 9,402   | 消費者金融                   |
| ALPHABET INC-CL C           | 34  | 2,648 | 300,786 | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ALPHABET INC-CL A           | 33  | 2,576 | 292,660 | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ALTRIA GROUP INC            | 222 | 1,410 | 160,189 | タバコ                     |
| AMAZON.COM INC              | 45  | 3,440 | 390,790 | インターネット販売・通信販売          |
| AMERCO                      | 0.8 | 28    | 3,189   | 陸運・鉄道                   |
| AMEREN CORPORATION          | 29  | 142   | 16,192  | 総合公益事業                  |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 18  | 82    | 9,399   | 旅客航空輸送業                 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER     | 58  | 347   | 39,469  | 電力                      |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 88  | 633   | 71,994  | 消費者金融                   |
| AMERICAN INTL GROUP         | 121 | 777   | 88,258  | 保険                      |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 21  | 152   | 17,297  | 水道                      |
| AMERISOURCEBERGEN CORP      | 20  | 165   | 18,791  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC    | 19  | 228   | 25,909  | 資本市場                    |
| AMETEK INC                  | 26  | 126   | 14,346  | 電気設備                    |
| AMGEN INC                   | 84  | 1,232 | 139,937 | バイオテクノロジー               |
| AMPHENOL CORP-CL A          | 36  | 244   | 27,743  | 電子装置・機器・部品              |
| ANADARKO PETE               | 61  | 416   | 47,313  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ANALOG DEVICES INC          | 32  | 232   | 26,381  | 半導体・半導体製造装置             |
| ANSYS INC                   | 9   | 88    | 10,018  | ソフトウェア                  |
| ANTERO RESOURCES CORP       | 24  | 63    | 7,229   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ANTHEM INC                  | 29  | 420   | 47,787  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APACHE CORPORATION          | 41  | 272   | 30,925  | 石油・ガス・消耗燃料              |

| 銘<br>柄                             | 株<br>数 | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等             |
|------------------------------------|--------|-------------|---------|-------------------------|
|                                    |        | 評<br>価<br>額 |         |                         |
|                                    |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                             | 百株     | 千米ドル        | 千円      |                         |
| APPLE INC                          | 607    | 6,622       | 752,237 | コンピュータ・周辺機器             |
| APPLIED MATERIALS                  | 120    | 378         | 42,974  | 半導体・半導体製造装置             |
| ARAMARK                            | 30     | 107         | 12,235  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARCHER DANIELS MIDLAND             | 63     | 276         | 31,412  | 食品                      |
| ARCONIC INC                        | 56     | 113         | 12,886  | 航空宇宙・防衛                 |
| ARROW ELECTRS INC                  | 11     | 81          | 9,219   | 電子装置・機器・部品              |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC        | 7      | 86          | 9,862   | 化学                      |
| ASSURANT INC                       | 6      | 59          | 6,791   | 保険                      |
| ATMOS ENERGY CORP                  | 11     | 78          | 8,889   | ガス                      |
| AUTODESK INC.                      | 23     | 163         | 18,594  | ソフトウェア                  |
| AUTOLIV INC                        | 10     | 104         | 11,886  | 自動車部品                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESS             | 50     | 488         | 55,528  | 情報技術サービス                |
| AUTONATION INC                     | 6      | 29          | 3,365   | 専門小売り                   |
| AUTOZONE                           | 3      | 246         | 28,043  | 専門小売り                   |
| AVERY DENNISON CORP                | 12     | 89          | 10,157  | 容器・包装                   |
| AVNET                              | 16     | 73          | 8,328   | 電子装置・機器・部品              |
| BB&T CORPORATION                   | 89     | 405         | 46,024  | 銀行                      |
| BAKER HUGHES                       | 44     | 291         | 33,138  | エネルギー設備・サービス            |
| BALL CORP                          | 20     | 152         | 17,285  | 容器・包装                   |
| BANK OF AMERICA CORP               | 1,145  | 2,500       | 284,027 | 銀行                      |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP        | 119    | 569         | 64,687  | 資本市場                    |
| BARD (C R)                         | 8      | 182         | 20,771  | ヘルスケア機器・用品              |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.          | 52     | 228         | 25,922  | ヘルスケア機器・用品              |
| B/E AEROSPACE INC                  | 10     | 61          | 6,995   | 航空宇宙・防衛                 |
| BECTON, DICKINSON                  | 23     | 381         | 43,322  | ヘルスケア機器・用品              |
| BED BATH & BEYOND                  | 19     | 88          | 10,013  | 専門小売り                   |
| WR BERKLEY CORP                    | 9      | 61          | 7,036   | 保険                      |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B        | 138    | 2,223       | 252,569 | 各種金融サービス                |
| BEST BUY COMPANY INC               | 33     | 154         | 17,548  | 専門小売り                   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        | 20     | 168         | 19,103  | バイオテクノロジー               |
| BIOGEN INC                         | 24     | 716         | 81,419  | バイオテクノロジー               |
| BLACKROCK INC                      | 13     | 509         | 57,825  | 資本市場                    |
| H & R BLOCK INC                    | 31     | 68          | 7,795   | 各種消費者サービス               |
| BOEING CO                          | 67     | 1,019       | 115,791 | 航空宇宙・防衛                 |
| BORGWARNER INC                     | 25     | 94          | 10,773  | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP             | 149    | 308         | 35,048  | ヘルスケア機器・用品              |
| BRISTOL MYERS SQUIBB               | 189    | 1,049       | 119,247 | 医薬品                     |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 16     | 102         | 11,637  | 情報技術サービス                |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B             | 24     | 111         | 12,698  | 飲料                      |
| CBS CORP-CL B                      | 44     | 268         | 30,479  | メディア                    |
| CBRE GROUP INC                     | 41     | 125         | 14,254  | 不動産管理・開発                |
| CDK GLOBAL INC                     | 14     | 83          | 9,482   | ソフトウェア                  |
| CDW CORPORATION                    | 15     | 79          | 8,987   | 電子装置・機器・部品              |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 24     | 68          | 7,790   | 化学                      |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC       | 16     | 122         | 13,871  | 航空貨物・物流サービス             |
| CIGNA CORP                         | 28     | 382         | 43,449  | ヘルスケア・プロバイダー・ヘルスケア・サービス |
| CIT GROUP INC                      | 19     | 79          | 9,029   | 銀行                      |
| CME GROUP INC                      | 37     | 443         | 50,354  | 資本市場                    |
| CMS ENERGY CORP                    | 35     | 139         | 15,869  | 総合公益事業                  |
| CSX CORP                           | 104    | 379         | 43,150  | 陸運・鉄道                   |
| CVS HEALTH CORP                    | 120    | 938         | 106,651 | 食品・生活必需品小売り             |
| CA INC                             | 39     | 122         | 13,895  | ソフトウェア                  |
| CABOT OIL & GAS CORP               | 46     | 108         | 12,345  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CADENCE DESIGN SYS INC             | 28     | 71          | 8,119   | ソフトウェア                  |

| 銘柄                            | 株数  | 当期末   |         | 業種等                     |
|-------------------------------|-----|-------|---------|-------------------------|
|                               |     | 評価額   |         |                         |
|                               |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                        | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                         |
| CALPINE CORP                  | 39  | 42    | 4,797   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| CAMPBELL SOUP CO              | 26  | 149   | 16,992  | 食品                      |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 56  | 488   | 55,447  | 消費者金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC           | 35  | 252   | 28,661  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARMAX INC                    | 22  | 131   | 14,908  | 専門小売り                   |
| CARNIVAL CORP                 | 38  | 196   | 22,283  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CATERPILLAR INC DEL           | 65  | 618   | 70,265  | 機械                      |
| CELANESE CORP-SERIES A        | 14  | 118   | 13,510  | 化学                      |
| CELGENE CORP                  | 87  | 1,022 | 116,105 | バイオテクノロジー               |
| CENTENE CORP                  | 21  | 119   | 13,585  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC        | 51  | 122   | 13,890  | 総合公益事業                  |
| CENTURYLINK INC               | 63  | 152   | 17,309  | 各種電気通信サービス              |
| CERNER CORP                   | 32  | 154   | 17,573  | ヘルスケア・テクノロジー            |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 24  | 661   | 75,084  | メディア                    |
| CHENIERE ENERGY INC           | 24  | 101   | 11,536  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHEVRON CORP                  | 211 | 2,397 | 272,308 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC    | 3   | 134   | 15,302  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CHURCH & DWIGHT CO INC        | 26  | 114   | 13,040  | 家庭用品                    |
| CIMAREX ENERGY CO             | 12  | 170   | 19,386  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 19  | 152   | 17,365  | 保険                      |
| CISCO SYSTEMS                 | 572 | 1,689 | 191,849 | 通信機器                    |
| CINTAS CORP                   | 9   | 106   | 12,067  | 商業サービス・用品               |
| CITIGROUP                     | 331 | 1,895 | 215,344 | 銀行                      |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP      | 55  | 187   | 21,333  | 銀行                      |
| CITRIX SYSTEMS INC            | 17  | 152   | 17,283  | ソフトウェア                  |
| CLOROX CO                     | 16  | 182   | 20,680  | 家庭用品                    |
| COACH INC                     | 32  | 121   | 13,792  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| COCA COLA CO                  | 467 | 1,896 | 215,456 | 飲料                      |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 67  | 366   | 41,671  | 情報技術サービス                |
| COLGATE PALMOLIVE CO.         | 95  | 613   | 69,736  | 家庭用品                    |
| COMCAST CORP-CL A             | 273 | 1,874 | 212,958 | メディア                    |
| COMERICA INC                  | 18  | 118   | 13,505  | 銀行                      |
| COMPUTER SCIENCES CORP        | 16  | 95    | 10,832  | 情報技術サービス                |
| CONAGRA BRANDS INC            | 48  | 178   | 20,253  | 食品                      |
| CONCHO RESOURCES INC          | 15  | 215   | 24,477  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONOCOPHILLIPS                | 139 | 679   | 77,169  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONSOLIDATED EDISON INC       | 32  | 223   | 25,340  | 総合公益事業                  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A    | 19  | 284   | 32,297  | 飲料                      |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK  | 11  | 67    | 7,697   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| THE COOPER COMPANIES, INC.    | 5   | 96    | 10,987  | ヘルスケア機器・用品              |
| CORNING INC                   | 111 | 262   | 29,791  | 電子装置・機器・部品              |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION  | 49  | 748   | 84,983  | 食品・生活必需品小売り             |
| COSTAR GROUP INC              | 3   | 68    | 7,743   | インターネットソフトウェア・サービス      |
| COTY INC-CL A                 | 64  | 118   | 13,469  | パーソナル用品                 |
| CROWN HOLDINGS INC            | 17  | 87    | 9,986   | 容器・包装                   |
| CUMMINS INC                   | 17  | 248   | 28,233  | 機械                      |
| DR HORTON INC                 | 42  | 115   | 13,123  | 家庭用耐久財                  |
| DTE ENERGY COMPANY            | 22  | 210   | 23,866  | 総合公益事業                  |
| DANAHER CORP                  | 69  | 535   | 60,869  | ヘルスケア機器・用品              |
| DARDEN RESTAURANTS INC        | 14  | 107   | 12,197  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DAVITA INC                    | 19  | 123   | 14,053  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY               | 28  | 291   | 33,133  | 機械                      |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V    | 24  | 128   | 14,638  | ソフトウェア                  |
| DELTA AIR LINES INC           | 24  | 114   | 13,035  | 旅客航空輸送業                 |

| 銘柄                                 | 株数  | 当 期 末 |         | 業 種 等                   |
|------------------------------------|-----|-------|---------|-------------------------|
|                                    |     | 評 価 額 |         |                         |
|                                    |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                             | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                         |
| DENTSPLY SIRONA INC                | 29  | 166   | 18,863  | ヘルスケア機器・用品              |
| DEVON ENERGY CORP                  | 57  | 272   | 30,907  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DEXCOM INC                         | 10  | 64    | 7,320   | ヘルスケア機器・用品              |
| DIAMONDBACK ENERGY INC             | 8   | 95    | 10,809  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DICK S SPORTING GOODS INC          | 13  | 79    | 9,023   | 専門小売り                   |
| DISNEY (WALT) CO                   | 173 | 1,735 | 197,096 | メディア                    |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES        | 44  | 296   | 33,708  | 消費者金融                   |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC       | 20  | 55    | 6,315   | メディア                    |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C         | 20  | 53    | 6,058   | メディア                    |
| DISH NETWORK CORP-A                | 24  | 140   | 15,959  | メディア                    |
| DOLLAR GENERAL CORP                | 33  | 252   | 28,624  | 複合小売り                   |
| DOLLAR TREE INC                    | 28  | 252   | 28,650  | 複合小売り                   |
| DOMINION RESOURCES INC/VA          | 70  | 515   | 58,587  | 総合公益事業                  |
| DOMINOS PIZZA INC                  | 4   | 78    | 8,876   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DOVER CORP                         | 17  | 132   | 15,005  | 機械                      |
| DOW CHEM CO                        | 127 | 711   | 80,864  | 化学                      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC        | 22  | 189   | 21,476  | 飲料                      |
| DU PONT E I DE NEMOURS             | 98  | 714   | 81,132  | 化学                      |
| DUKE ENERGY CORP                   | 77  | 568   | 64,544  | 電力                      |
| DUN & BRADSTREET CORP              | 3   | 41    | 4,737   | 専門サービス                  |
| EOG RESOURCES INC                  | 64  | 674   | 76,645  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| EQT CORP                           | 21  | 156   | 17,784  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| E*TRADE FINANCIAL CORP             | 31  | 109   | 12,397  | 資本市場                    |
| EASTMAN CHEMICAL CO.               | 14  | 111   | 12,714  | 化学                      |
| EATON VANCE CORP                   | 15  | 61    | 6,935   | 資本市場                    |
| EBAY INC                           | 118 | 334   | 37,995  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ECOLAB INC                         | 28  | 342   | 38,916  | 化学                      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO          | 6   | 48    | 5,523   | パーソナル用品                 |
| EDISON INTERNATIONAL               | 35  | 244   | 27,723  | 電力                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP          | 26  | 216   | 24,547  | ヘルスケア機器・用品              |
| ELECTRONIC ARTS                    | 32  | 249   | 28,325  | ソフトウェア                  |
| EMERSON ELEC                       | 70  | 398   | 45,262  | 電気設備                    |
| ENTERGY CORP                       | 18  | 124   | 14,184  | 電力                      |
| ENVISION HEALTHCARE CORP           | 13  | 93    | 10,594  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EQUIFAX INC                        | 14  | 169   | 19,218  | 専門サービス                  |
| EVERSOURCE ENERGY                  | 39  | 202   | 23,003  | 電力                      |
| EXELON CORPORATION                 | 110 | 366   | 41,629  | 電力                      |
| EXPEDIA INC                        | 14  | 174   | 19,808  | インターネット販売・通信販売          |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC  | 22  | 118   | 13,508  | 航空貨物・物流サービス             |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON | 70  | 540   | 61,337  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EXXON MOBIL CORP                   | 466 | 4,080 | 463,513 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FLIR SYSTEMS INC                   | 12  | 42    | 4,867   | 電子装置・機器・部品              |
| FMC CORP                           | 16  | 95    | 10,859  | 化学                      |
| FMC TECHNOLOGIES INC               | 26  | 94    | 10,763  | エネルギー設備・サービス            |
| FACEBOOK INC-A                     | 261 | 3,066 | 348,247 | インターネットソフトウェア・サービス      |
| FASTENAL CO                        | 36  | 174   | 19,863  | 商社・流通業                  |
| FEDEX CORPORATION                  | 28  | 548   | 62,297  | 航空貨物・物流サービス             |
| F5 NETWORKS INC                    | 7   | 103   | 11,794  | 通信機器                    |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION      | 34  | 255   | 29,071  | 情報技術サービス                |
| FNF GROUP                          | 34  | 108   | 12,330  | 保険                      |
| FIFTH THIRD BANCORP                | 82  | 213   | 24,299  | 銀行                      |
| FIRST DATA CORP- CLASS A           | 35  | 49    | 5,640   | 情報技術サービス                |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 18  | 158   | 18,047  | 銀行                      |
| FISERV INC                         | 23  | 247   | 28,131  | 情報技術サービス                |

| 銘柄                                 | 株数    | 当期末   |         | 業種等                     |
|------------------------------------|-------|-------|---------|-------------------------|
|                                    |       | 評価額   |         |                         |
|                                    |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                             | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                         |
| FIRSTENERGY CORP                   | 53    | 161   | 18,360  | 電力                      |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 11    | 173   | 19,751  | 情報技術サービス                |
| FLUOR CORP                         | 14    | 75    | 8,519   | 建設・土木                   |
| FLOWSERVE CORP                     | 14    | 72    | 8,236   | 機械                      |
| FOOT LOCKER INC                    | 17    | 129   | 14,686  | 専門小売り                   |
| FORD MOTOR COMPANY                 | 413   | 513   | 58,354  | 自動車                     |
| FORTINET INC                       | 15    | 45    | 5,148   | ソフトウェア                  |
| FORTIVE CORP                       | 33    | 177   | 20,206  | 機械                      |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 17    | 93    | 10,613  | 建設関連製品                  |
| FRANKLIN RESOURCES INC             | 43    | 172   | 19,599  | 資本市場                    |
| FREEPORT-MCMORAN INC               | 150   | 238   | 27,037  | 金属・鉱業                   |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CO         | 113   | 38    | 4,389   | 各種電気通信サービス              |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO            | 17    | 83    | 9,523   | 保険                      |
| GAP INC                            | 24    | 59    | 6,801   | 専門小売り                   |
| GARTNER INC                        | 9     | 92    | 10,521  | 情報技術サービス                |
| GENERAL DYNAMICS                   | 29    | 517   | 58,801  | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL ELEC CO                    | 1,007 | 3,132 | 355,820 | コングロマリット                |
| GENERAL MILLS                      | 65    | 397   | 45,130  | 食品                      |
| GENERAL MOTORS CO                  | 156   | 545   | 61,908  | 自動車                     |
| GENUINE PARTS CO                   | 15    | 151   | 17,248  | 販売                      |
| GILEAD SCIENCES INC                | 149   | 1,081 | 122,786 | バイオテクノロジー               |
| GLOBAL PAYMENTS INC                | 19    | 138   | 15,681  | 情報技術サービス                |
| GOLDMAN SACHS GROUP                | 41    | 941   | 106,949 | 資本市場                    |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO          | 28    | 84    | 9,585   | 自動車部品                   |
| WR GRACE & CO                      | 8     | 51    | 5,865   | 化学                      |
| GRAINGER(W.W.) INC                 | 5     | 138   | 15,767  | 商社・流通業                  |
| HCA HOLDINGS INC                   | 33    | 232   | 26,454  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HP INC                             | 187   | 290   | 33,027  | コンピュータ・周辺機器             |
| HALLIBURTON CO                     | 96    | 517   | 58,770  | エネルギー設備・サービス            |
| HANESBRANDS INC                    | 49    | 112   | 12,772  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| HARLEY-DAVIDSON INC                | 18    | 107   | 12,262  | 自動車                     |
| HARMAN INTERNATIONAL               | 7     | 78    | 8,967   | 家庭用耐久財                  |
| HARRIS CORP                        | 12    | 136   | 15,522  | 通信機器                    |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES        | 41    | 195   | 22,175  | 保険                      |
| HASBRO INC                         | 14    | 124   | 14,088  | レジャー用品                  |
| HELMERICH & PAYNE                  | 10    | 81    | 9,235   | エネルギー設備・サービス            |
| HERSHEY CO/THE                     | 15    | 148   | 16,899  | 食品                      |
| HESS CORP                          | 35    | 206   | 23,454  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE         | 185   | 447   | 50,870  | コンピュータ・周辺機器             |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC      | 69    | 180   | 20,446  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HOLLYFRONTIER CORP                 | 16    | 49    | 5,649   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HOLOGIC INC                        | 30    | 115   | 13,121  | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT                         | 140   | 1,823 | 207,090 | 専門小売り                   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 81    | 921   | 104,618 | コングロマリット                |
| HORMEL FOODS CORP                  | 35    | 118   | 13,432  | 食品                      |
| HUMANA INC                         | 16    | 342   | 38,899  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC        | 8     | 85    | 9,762   | 陸運・鉄道                   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC          | 125   | 162   | 18,499  | 銀行                      |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE       | 5     | 98    | 11,242  | 航空宇宙・防衛                 |
| IDEXX LABORATORIES INC             | 9     | 102   | 11,663  | ヘルスケア機器・用品              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC            | 35    | 447   | 50,848  | 機械                      |
| ILLUMINA INC                       | 17    | 228   | 26,007  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| INCYTE CORP                        | 18    | 189   | 21,536  | バイオテクノロジー               |
| INGREDION INC                      | 9     | 113   | 12,914  | 食品                      |

| 銘柄                                       | 柄 | 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    | 千米ドル 千円      |         |                         |
| INTEL CORP                               |   | 537   | 1,846        | 209,753 | 半導体・半導体製造装置             |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC            |   | 65    | 375          | 42,664  | 資本市場                    |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES          |   | 103   | 1,649        | 187,355 | 情報技術サービス                |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE        |   | 8     | 107          | 12,232  | 化学                      |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)               |   | 42    | 215          | 24,524  | 容器・包装                   |
| INTERPUBLIC GROUP                        |   | 49    | 117          | 13,357  | メディア                    |
| INTUIT INC                               |   | 26    | 306          | 34,841  | ソフトウェア                  |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   |   | 4     | 291          | 33,061  | ヘルスケア機器・用品              |
| JPMORGAN CHASE & CO                      |   | 406   | 3,380        | 383,940 | 銀行                      |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC             |   | 12    | 76           | 8,633   | 建設・土木                   |
| JOHNSON & JOHNSON                        |   | 307   | 3,443        | 391,087 | 医薬品                     |
| JONES LANG LASALLE INC                   |   | 4     | 47           | 5,386   | 不動産管理・開発                |
| JUNIPER NETWORKS INC                     |   | 41    | 110          | 12,540  | 通信機器                    |
| KLA TENCOR CORP                          |   | 16    | 124          | 14,173  | 半導体・半導体製造装置             |
| KANSAS CITY SOUTHERN                     |   | 12    | 106          | 12,136  | 陸運・鉄道                   |
| KELLOGG CO                               |   | 30    | 215          | 24,420  | 食品                      |
| KEYCORP                                  |   | 124   | 219          | 24,928  | 銀行                      |
| KIMBERLY-CLARK CORP                      |   | 40    | 454          | 51,624  | 家庭用品                    |
| KINDER MORGAN INC                        |   | 211   | 452          | 51,429  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KOHL'S CORP                              |   | 21    | 117          | 13,311  | 複合小売り                   |
| KRAFT HEINZ CO/THE                       |   | 68    | 546          | 62,094  | 食品                      |
| KROGER CO                                |   | 99    | 326          | 37,027  | 食品・生活必需品小売り             |
| L BRANDS, INC                            |   | 26    | 187          | 21,253  | 専門小売り                   |
| LKQ CORP                                 |   | 40    | 130          | 14,842  | 販売                      |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS                 |   | 8     | 141          | 16,018  | 航空宇宙・防衛                 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS             |   | 10    | 131          | 14,937  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH                             |   | 16    | 172          | 19,539  | 半導体・半導体製造装置             |
| LAS VEGAS SANDS CORP                     |   | 48    | 293          | 33,321  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A              |   | 27    | 209          | 23,837  | パーソナル用品                 |
| LEAR CORP                                |   | 8     | 106          | 12,069  | 自動車部品                   |
| LEGGETT & PLATT INC                      |   | 14    | 67           | 7,710   | 家庭用耐久財                  |
| LENNAR CORP-A                            |   | 19    | 80           | 9,154   | 家庭用耐久財                  |
| LEUCADIA NATIONAL CORP                   |   | 30    | 68           | 7,823   | 各種金融サービス                |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC               |   | 36    | 201          | 22,942  | 各種電気通信サービス              |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C                 |   | 12    | 86           | 9,878   | メディア                    |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A |   | 52    | 108          | 12,278  | インターネット販売・通信販売          |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP                   |   | 11    | 40           | 4,556   | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C                   |   | 20    | 69           | 7,887   | メディア                    |
| ELI LILLY & CO.                          |   | 112   | 753          | 85,561  | 医薬品                     |
| LINCOLN NATIONAL CORP                    |   | 27    | 177          | 20,157  | 保険                      |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP                   |   | 25    | 154          | 17,494  | 半導体・半導体製造装置             |
| LINKEDIN CORP - A                        |   | 14    | 279          | 31,712  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| LOCKHEED MARTIN                          |   | 29    | 795          | 90,347  | 航空宇宙・防衛                 |
| LOEWS CORP                               |   | 35    | 158          | 17,972  | 保険                      |
| LOWES COS INC                            |   | 99    | 719          | 81,701  | 専門小売り                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC                  |   | 14    | 83           | 9,536   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| M & T BANK CORP                          |   | 16    | 246          | 27,947  | 銀行                      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL                |   | 58    | 168          | 19,084  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MSCI INC                                 |   | 11    | 88           | 10,088  | 資本市場                    |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION     |   | 8     | 72           | 8,243   | 運送インフラ                  |
| MACYS INC                                |   | 37    | 155          | 17,660  | 複合小売り                   |
| MANPOWERGROUP INC                        |   | 9     | 83           | 9,524   | 専門サービス                  |
| MARATHON OIL CORP                        |   | 104   | 191          | 21,722  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARATHON PETROLEUM CORP                  |   | 58    | 278          | 31,627  | 石油・ガス・消耗燃料              |

| 銘                               | 柄 | 当   |   | 期     |         | 業                       | 種 | 等 |
|---------------------------------|---|-----|---|-------|---------|-------------------------|---|---|
|                                 |   | 株   | 数 | 未     |         |                         |   |   |
|                                 |   |     |   | 評     | 価       |                         |   |   |
|                                 |   |     |   | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |   |   |
| (アメリカ)                          |   | 百株  |   | 千米ドル  | 千円      |                         |   |   |
| MARKEL CORP                     |   | 1   |   | 125   | 14,291  | 保険                      |   |   |
| MARSH & MCLENNAN COS            |   | 57  |   | 391   | 44,470  | 保険                      |   |   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA      |   | 36  |   | 293   | 33,303  | ホテル・レストラン・レジャー          |   |   |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS       |   | 6   |   | 138   | 15,741  | 建設資材                    |   |   |
| MASCO CORP                      |   | 33  |   | 102   | 11,690  | 建設関連製品                  |   |   |
| MASTERCARD INC                  |   | 109 |   | 1,136 | 129,138 | 情報技術サービス                |   |   |
| MATTEL INC                      |   | 34  |   | 101   | 11,511  | レジャー用品                  |   |   |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS       |   | 37  |   | 141   | 16,070  | 半導体・半導体製造装置             |   |   |
| MCCORMICK & CO INC.             |   | 14  |   | 127   | 14,449  | 食品                      |   |   |
| MCDONALD'S CORP                 |   | 96  |   | 1,153 | 131,018 | ホテル・レストラン・レジャー          |   |   |
| MCKESSON CORP                   |   | 24  |   | 355   | 40,349  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |   |   |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO       |   | 22  |   | 159   | 18,118  | 食品                      |   |   |
| MEDNAX INC                      |   | 10  |   | 65    | 7,487   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |   |   |
| MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR   |   | 29  |   | 54    | 6,245   | ホテル・レストラン・レジャー          |   |   |
| MERCADOLIBRE INC                |   | 4   |   | 72    | 8,252   | インターネットソフトウェア・サービス      |   |   |
| MERCK & CO INC                  |   | 315 |   | 1,897 | 215,560 | 医薬品                     |   |   |
| METLIFE INC                     |   | 105 |   | 584   | 66,391  | 保険                      |   |   |
| METTLER-TOLEDO INTL             |   | 2   |   | 119   | 13,601  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |   |   |
| MICROSOFT CORP                  |   | 833 |   | 5,016 | 569,754 | ソフトウェア                  |   |   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY            |   | 27  |   | 170   | 19,390  | 半導体・半導体製造装置             |   |   |
| MICRON TECHNOLOGY               |   | 112 |   | 208   | 23,673  | 半導体・半導体製造装置             |   |   |
| MIDDLEBY CORP                   |   | 6   |   | 91    | 10,446  | 機械                      |   |   |
| MOHAWK INDUSTRIES               |   | 6   |   | 126   | 14,393  | 家庭用耐久財                  |   |   |
| MOLSON COORS BREWING CO-B       |   | 23  |   | 222   | 25,281  | 飲料                      |   |   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC      |   | 175 |   | 718   | 81,553  | 食品                      |   |   |
| MONSANTO CO                     |   | 48  |   | 501   | 56,964  | 化学                      |   |   |
| MONSTER BEVERAGE CORP           |   | 45  |   | 204   | 23,249  | 飲料                      |   |   |
| MOODYS CORP                     |   | 18  |   | 176   | 20,016  | 資本市場                    |   |   |
| MORGAN STANLEY                  |   | 161 |   | 677   | 76,967  | 資本市場                    |   |   |
| MOSAIC CO/THE                   |   | 36  |   | 106   | 12,126  | 化学                      |   |   |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC          |   | 15  |   | 125   | 14,245  | 通信機器                    |   |   |
| MURPHY OIL CORP                 |   | 17  |   | 58    | 6,684   | 石油・ガス・消耗燃料              |   |   |
| NASDAQ INC                      |   | 14  |   | 92    | 10,460  | 資本市場                    |   |   |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC      |   | 41  |   | 161   | 18,288  | エネルギー設備・サービス            |   |   |
| NAVIENT CORP                    |   | 47  |   | 79    | 9,075   | 消費者金融                   |   |   |
| NETAPP INC                      |   | 32  |   | 113   | 12,888  | コンピュータ・周辺機器             |   |   |
| NETFLIX INC                     |   | 48  |   | 571   | 64,964  | インターネット販売・通信販売          |   |   |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD      |   | 160 |   | 100   | 11,394  | 不動産管理・開発                |   |   |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD      |   | 26  |   | 142   | 16,224  | コングロマリット                |   |   |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP      |   | 60  |   | 97    | 11,060  | 貯蓄・抵当・不動産金融             |   |   |
| NEWELL BRANDS INC               |   | 46  |   | 210   | 23,876  | 家庭用耐久財                  |   |   |
| NEWFIELD EXPLORATION CO         |   | 26  |   | 118   | 13,474  | 石油・ガス・消耗燃料              |   |   |
| NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO |   | 63  |   | 210   | 23,956  | 金属・鉱業                   |   |   |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I          |   | 43  |   | 50    | 5,767   | メディア                    |   |   |
| NEXTERA ENERGY INC              |   | 51  |   | 595   | 67,659  | 電力                      |   |   |
| NIKE INC-B                      |   | 152 |   | 788   | 89,514  | 繊維・アパレル・贅沢品             |   |   |
| NISOURCE INC                    |   | 42  |   | 90    | 10,323  | 総合公益事業                  |   |   |
| NOBLE ENERGY INC                |   | 51  |   | 201   | 22,880  | 石油・ガス・消耗燃料              |   |   |
| NORDSTROM INC                   |   | 15  |   | 90    | 10,264  | 複合小売り                   |   |   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP           |   | 32  |   | 342   | 38,872  | 陸運・鉄道                   |   |   |
| NORTHERN TRUST CORP             |   | 22  |   | 193   | 21,921  | 資本市場                    |   |   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP           |   | 18  |   | 467   | 53,127  | 航空宇宙・防衛                 |   |   |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC       |   | 22  |   | 35    | 3,990   | ソフトウェア                  |   |   |
| NUCOR CORP                      |   | 34  |   | 221   | 25,139  | 金属・鉱業                   |   |   |

| 銘柄                           | 株数  | 当期末   |         | 業種等                     |
|------------------------------|-----|-------|---------|-------------------------|
|                              |     | 評価額   |         |                         |
|                              |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                       | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                         |
| NVIDIA CORP                  | 59  | 549   | 62,405  | 半導体・半導体製造装置             |
| OGE ENERGY CORP              | 24  | 77    | 8,834   | 電力                      |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,      | 10  | 287   | 32,657  | 専門小売り                   |
| OCCIDENTAL PETE CORP         | 86  | 610   | 69,332  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| OMNICOM GROUP                | 25  | 220   | 25,020  | メディア                    |
| ONEOK INC                    | 22  | 128   | 14,610  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ORACLE CORPORATION           | 351 | 1,367 | 155,360 | ソフトウェア                  |
| PG&E CORP                    | 55  | 321   | 36,469  | 電力                      |
| PNC FINANCIAL                | 55  | 614   | 69,779  | 銀行                      |
| PPG INDUSTRIES               | 29  | 279   | 31,726  | 化学                      |
| PPL CORPORATION              | 82  | 272   | 30,967  | 電力                      |
| PVH CORP                     | 9   | 97    | 11,055  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| PACCAR                       | 38  | 248   | 28,231  | 機械                      |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 10  | 90    | 10,294  | 容器・包装                   |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 9   | 117   | 13,327  | 通信機器                    |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 14  | 203   | 23,138  | 機械                      |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 17  | 62    | 7,117   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PATTERSON COS INC            | 11  | 43    | 4,948   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PAYCHEX INC                  | 40  | 235   | 26,727  | 情報技術サービス                |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 121 | 471   | 53,584  | 情報技術サービス                |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC | 44  | 83    | 9,460   | 銀行                      |
| PEPSICO INC                  | 163 | 1,647 | 187,136 | 飲料                      |
| PFIZER INC                   | 680 | 2,148 | 243,983 | 医薬品                     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 176 | 1,547 | 175,751 | タバコ                     |
| PHILLIPS 66                  | 51  | 440   | 49,977  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP   | 11  | 84    | 9,642   | 電力                      |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 18  | 346   | 39,341  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A   | 9   | 30    | 3,496   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 6   | 56    | 6,429   | レジャー用品                  |
| PRAXAIR INC                  | 31  | 372   | 42,303  | 化学                      |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 27  | 204   | 23,177  | 資本市場                    |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 5   | 835   | 94,880  | インターネット販売・通信販売          |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 31  | 184   | 20,939  | 保険                      |
| PROCTER & GAMBLE CO          | 287 | 2,381 | 270,526 | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CO               | 63  | 209   | 23,842  | 保険                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 48  | 500   | 56,812  | 保険                      |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE        | 55  | 229   | 26,074  | 総合公益事業                  |
| PULTEGROUP INC               | 43  | 78    | 8,927   | 家庭用耐久財                  |
| QORVO INC                    | 16  | 87    | 9,954   | 半導体・半導体製造装置             |
| QUALCOMM INC                 | 167 | 1,108 | 125,870 | 半導体・半導体製造装置             |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 16  | 149   | 16,953  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| QUINTILES IMS HOLDINGS INC   | 19  | 143   | 16,353  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| RALPH LAUREN CORPORATION     | 6   | 69    | 7,864   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| RANGE RESOURCES CORP         | 18  | 70    | 8,029   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 13  | 95    | 10,855  | 資本市場                    |
| RAYTHEON COMPANY             | 32  | 490   | 55,704  | 航空宇宙・防衛                 |
| RED HAT INC                  | 19  | 147   | 16,772  | ソフトウェア                  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 8   | 314   | 35,703  | バイオテクノロジー               |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 147 | 206   | 23,408  | 銀行                      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 7   | 89    | 10,168  | 保険                      |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A   | 29  | 160   | 18,208  | 商業サービス・用品               |
| RESMED INC                   | 17  | 101   | 11,571  | ヘルスケア機器・用品              |
| REYNOLDS AMERICAN INC        | 96  | 527   | 59,893  | タバコ                     |
| RITE AID CORP                | 101 | 81    | 9,246   | 食品・生活必需品小売り             |

| 銘<br>柄                        | 株<br>数 | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等             |
|-------------------------------|--------|-------------|---------|-------------------------|
|                               |        | 評<br>価<br>額 |         |                         |
|                               |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                        | 百株     | 千米ドル        | 千円      |                         |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 14     | 66          | 7,537   | 専門サービス                  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 14     | 202         | 23,053  | 電気設備                    |
| ROCKWELL COLLINS INC          | 14     | 137         | 15,588  | 航空宇宙・防衛                 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 12     | 227         | 25,788  | コングロマリット                |
| ROSS STORES INC               | 44     | 295         | 33,558  | 専門小売り                   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A  | 12     | 124         | 14,144  | 各種電気通信サービス              |
| S&P GLOBAL INC                | 28     | 327         | 37,252  | 資本市場                    |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 14     | 67          | 7,658   | 資本市場                    |
| SABRE CORP                    | 19     | 48          | 5,457   | 情報技術サービス                |
| ST JUDE MEDICAL INC           | 34     | 274         | 31,148  | ヘルスケア機器・用品              |
| SALESFORCE.COM INC            | 72     | 509         | 57,898  | ソフトウェア                  |
| SCANA CORP                    | 13     | 92          | 10,555  | 総合公益事業                  |
| HENRY SCHEIN INC              | 9      | 139         | 15,838  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD              | 157    | 1,331       | 151,227 | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP         | 133    | 518         | 58,913  | 資本市場                    |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A   | 12     | 83          | 9,431   | メディア                    |
| SEALED AIR CORP               | 23     | 106         | 12,126  | 容器・包装                   |
| SEATTLE GENETICS INC          | 11     | 72          | 8,278   | バイオテクノロジー               |
| SEMPRA ENERGY                 | 28     | 282         | 32,129  | 総合公益事業                  |
| SERVICENOW INC                | 19     | 151         | 17,236  | ソフトウェア                  |
| SHERWIN-WILLIAMS              | 8      | 226         | 25,719  | 化学                      |
| SIGNATURE BANK                | 5      | 78          | 8,933   | 銀行                      |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC        | 170    | 73          | 8,360   | メディア                    |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | 19     | 145         | 16,486  | 半導体・半導体製造装置             |
| SMITH (A. O.) CORP            | 20     | 102         | 11,675  | 建設関連製品                  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW         | 12     | 154         | 17,604  | 食品                      |
| SNAP-ON INC                   | 7      | 125         | 14,206  | 機械                      |
| SOUTHERN CO.                  | 108    | 506         | 57,493  | 電力                      |
| SOUTHWEST AIRLINES            | 15     | 70          | 8,019   | 旅客航空輸送業                 |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO        | 67     | 82          | 9,352   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SPECTRA ENERGY CORP           | 82     | 333         | 37,924  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC  | 3      | 35          | 4,072   | 家庭用品                    |
| SPLUNK INC                    | 18     | 100         | 11,463  | ソフトウェア                  |
| SPRINT CORP                   | 73     | 58          | 6,674   | 無線通信サービス                |
| STANLEY BLACK & DECKER INC    | 18     | 216         | 24,630  | 機械                      |
| STAPLES INC                   | 74     | 72          | 8,194   | 専門小売り                   |
| STARBUCKS CORP                | 166    | 954         | 108,412 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STATE STREET CORP             | 42     | 339         | 38,571  | 資本市場                    |
| STERICYCLE INC                | 8      | 62          | 7,076   | 商業サービス・用品               |
| STRYKER CORP                  | 36     | 412         | 46,817  | ヘルスケア機器・用品              |
| SUNTRUST BKS INC.             | 54     | 283         | 32,224  | 銀行                      |
| SYMANTEC CORP                 | 75     | 182         | 20,742  | ソフトウェア                  |
| SYNOPSIS INC                  | 17     | 97          | 11,086  | ソフトウェア                  |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 92     | 323         | 36,687  | 消費者金融                   |
| SYSCO CORP                    | 58     | 310         | 35,230  | 食品・生活必需品小売り             |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP    | 28     | 117         | 13,344  | 資本市場                    |
| TJX COS INC                   | 73     | 568         | 64,556  | 専門小売り                   |
| T-MOBILE US INC               | 33     | 181         | 20,622  | 無線通信サービス                |
| TARGET CORP                   | 60     | 468         | 53,159  | 複合小売り                   |
| TARGA RESOURCES CORP          | 19     | 101         | 11,510  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TEGNA INC                     | 23     | 51          | 5,856   | メディア                    |
| TELEFLEX INC                  | 5      | 77          | 8,757   | ヘルスケア機器・用品              |
| TESORO CORP                   | 13     | 116         | 13,284  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TESLA MOTORS INC              | 15     | 283         | 32,249  | 自動車                     |

| 銘柄                                   | 柄 | 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    | 千米ドル         | 千円      |                         |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR           |   | 101   | 374          | 42,490  | 医薬品                     |
| TEXAS INSTRUMENTS INC                |   | 113   | 797          | 90,576  | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXTRON INC                          |   | 28    | 132          | 15,061  | 航空宇宙・防衛                 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC         |   | 44    | 624          | 70,976  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| 3M CORP                              |   | 68    | 1,175        | 133,524 | コングロマリット                |
| TIFFANY & CO                         |   | 13    | 114          | 13,047  | 専門小売り                   |
| TIME WARNER INC                      |   | 87    | 818          | 92,975  | メディア                    |
| TOLL BROTHERS INC                    |   | 14    | 42           | 4,845   | 家庭用耐久財                  |
| TORCHMARK CORP                       |   | 12    | 87           | 9,992   | 保険                      |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC            |   | 22    | 107          | 12,173  | 情報技術サービス                |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY               |   | 15    | 121          | 13,757  | 専門小売り                   |
| TRANSDIGM GROUP INC                  |   | 6     | 155          | 17,702  | 航空宇宙・防衛                 |
| TRAVELERS COS INC/THE                |   | 31    | 368          | 41,850  | 保険                      |
| TRIMBLE INC                          |   | 25    | 72           | 8,234   | 電子装置・機器・部品              |
| TRIPADVISOR INC                      |   | 13    | 62           | 7,084   | インターネット販売・通信販売          |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC         |   | 117   | 322          | 36,624  | メディア                    |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B |   | 48    | 132          | 15,008  | メディア                    |
| TWITTER INC                          |   | 71    | 129          | 14,701  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| TYSON FOODS INC-CL A                 |   | 36    | 206          | 23,417  | 食品                      |
| UGI CORP                             |   | 23    | 102          | 11,585  | ガス                      |
| US BANCORP                           |   | 193   | 971          | 110,393 | 銀行                      |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR         |   | 6     | 159          | 18,140  | 専門小売り                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A             |   | 21    | 63           | 7,258   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C             |   | 21    | 52           | 6,017   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNION PAC CORP                       |   | 94    | 967          | 109,914 | 陸運・鉄道                   |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC      |   | 8     | 58           | 6,667   | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B           |   | 78    | 910          | 103,395 | 航空貨物・物流サービス             |
| UNITED RENTALS INC                   |   | 10    | 111          | 12,678  | 商社・流通業                  |
| UNITED TECHNOLOGIES                  |   | 89    | 965          | 109,684 | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP             |   | 4     | 63           | 7,199   | バイオテクノロジー               |
| UNITEDHEALTH GROUP INC               |   | 108   | 1,707        | 193,896 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B          |   | 11    | 147          | 16,723  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNUM GROUP                           |   | 26    | 111          | 12,659  | 保険                      |
| V F CORP                             |   | 36    | 205          | 23,380  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VALERO ENERGY CORP                   |   | 51    | 329          | 37,373  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VALSPAR CORP                         |   | 10    | 102          | 11,589  | 化学                      |
| VANTIV INC - CL A                    |   | 19    | 107          | 12,238  | 情報技術サービス                |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC           |   | 10    | 93           | 10,642  | ヘルスケア機器・用品              |
| VERISIGN INC                         |   | 12    | 95           | 10,830  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| VERIZON COMMUNICATIONS               |   | 457   | 2,273        | 258,232 | 各種電気通信サービス              |
| VERISK ANALYTICS INC                 |   | 17    | 145          | 16,573  | 専門サービス                  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS               |   | 30    | 227          | 25,828  | バイオテクノロジー               |
| VIACOM INC-CLASS B                   |   | 36    | 131          | 14,977  | メディア                    |
| VISA INC-CLASS A SHARES              |   | 214   | 1,658        | 188,349 | 情報技術サービス                |
| VMWARE INC - CLASS A                 |   | 10    | 80           | 9,110   | ソフトウェア                  |
| VOYA FINANCIAL INC                   |   | 25    | 98           | 11,216  | 各種金融サービス                |
| VULCAN MATERIALS CO                  |   | 14    | 181          | 20,563  | 建設資材                    |
| WABCO HOLDINGS INC                   |   | 5     | 63           | 7,183   | 機械                      |
| WEC ENERGY GROUP INC                 |   | 36    | 200          | 22,770  | 総合公益事業                  |
| WABTEC CORP                          |   | 8     | 75           | 8,607   | 機械                      |
| WAL-MART STORES INC                  |   | 175   | 1,223        | 139,016 | 食品・生活必需品小売り             |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC         |   | 103   | 882          | 100,211 | 食品・生活必需品小売り             |
| WASTE CONNECTIONS INC                |   | 20    | 154          | 17,568  | 商業サービス・用品               |
| WASTE MANAGEMENT INC                 |   | 49    | 338          | 38,401  | 商業サービス・用品               |

| 銘                                  | 柄 | 当   |   | 期     |         | 業                  | 種 | 等 |
|------------------------------------|---|-----|---|-------|---------|--------------------|---|---|
|                                    |   | 株   | 数 | 未     |         |                    |   |   |
|                                    |   |     |   | 評     | 価       |                    |   |   |
|                                    |   |     |   | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                    |   |   |
| (アメリカ)                             |   | 百株  |   | 千米ドル  | 千円      |                    |   |   |
| WATERS CORP                        |   | 8   |   | 109   | 12,404  | ライフサイエンス・ツール/サービス  |   |   |
| WELLS FARGO CO                     |   | 538 |   | 2,924 | 332,111 | 銀行                 |   |   |
| WESTAR ENERGY INC                  |   | 19  |   | 107   | 12,240  | 電力                 |   |   |
| WESTERN DIGITAL CORP               |   | 35  |   | 217   | 24,682  | コンピュータ・周辺機器        |   |   |
| WESTERN UNION CO                   |   | 54  |   | 112   | 12,812  | 情報技術サービス           |   |   |
| WESTROCK CO                        |   | 28  |   | 146   | 16,583  | 容器・包装              |   |   |
| WHIRLPOOL CORP                     |   | 8   |   | 149   | 16,991  | 家庭用耐久財             |   |   |
| WHITEWAVE FOODS CO - CL A          |   | 20  |   | 110   | 12,530  | 食品                 |   |   |
| WHOLE FOODS MARKET INC             |   | 40  |   | 123   | 13,974  | 食品・生活必需品小売り        |   |   |
| WILLIAMS COS                       |   | 76  |   | 238   | 27,113  | 石油・ガス・消耗燃料         |   |   |
| WORKDAY INC-CLASS A                |   | 15  |   | 113   | 12,887  | ソフトウェア             |   |   |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP             |   | 12  |   | 93    | 10,668  | ホテル・レストラン・レジャー     |   |   |
| WYNN RESORTS LTD                   |   | 9   |   | 90    | 10,279  | ホテル・レストラン・レジャー     |   |   |
| XCEL ENERGY INC                    |   | 62  |   | 240   | 27,315  | 電力                 |   |   |
| XILINX INC                         |   | 26  |   | 141   | 16,055  | 半導体・半導体製造装置        |   |   |
| XEROX CORP                         |   | 100 |   | 93    | 10,585  | 情報技術サービス           |   |   |
| XYLEM INC                          |   | 24  |   | 124   | 14,098  | 機械                 |   |   |
| YAHOO! INC                         |   | 99  |   | 397   | 45,202  | インターネットソフトウェア・サービス |   |   |
| YUM BRANDS INC                     |   | 40  |   | 252   | 28,649  | ホテル・レストラン・レジャー     |   |   |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC            |   | 18  |   | 60    | 6,848   | 各種電気通信サービス         |   |   |
| ZILLOW GROUP INC - C               |   | 11  |   | 38    | 4,423   | インターネットソフトウェア・サービス |   |   |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC         |   | 24  |   | 245   | 27,879  | ヘルスケア機器・用品         |   |   |
| ZOETIS INC                         |   | 51  |   | 254   | 28,858  | 医薬品                |   |   |
| ALKERMES PLC                       |   | 16  |   | 92    | 10,470  | バイオテクノロジー          |   |   |
| ALLERGAN PLC                       |   | 44  |   | 854   | 97,062  | 医薬品                |   |   |
| AON PLC                            |   | 29  |   | 328   | 37,267  | 保険                 |   |   |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD             |   | 13  |   | 111   | 12,681  | 保険                 |   |   |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD          |   | 10  |   | 61    | 7,027   | 保険                 |   |   |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD         |   | 26  |   | 66    | 7,565   | 化学                 |   |   |
| ACCENTURE PLC-CL A                 |   | 70  |   | 826   | 93,861  | 情報技術サービス           |   |   |
| BUNGE LIMITED                      |   | 16  |   | 113   | 12,864  | 食品                 |   |   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC              |   | 32  |   | 204   | 23,170  | 自動車部品              |   |   |
| EATON CORP PLC                     |   | 50  |   | 340   | 38,622  | 電気設備               |   |   |
| ENDO INTERNATIONAL PLC             |   | 21  |   | 33    | 3,857   | 医薬品                |   |   |
| EVEREST RE GROUP LTD               |   | 4   |   | 92    | 10,473  | 保険                 |   |   |
| IHS MARKIT LTD                     |   | 43  |   | 150   | 17,044  | 専門サービス             |   |   |
| INGERSOLL-RAND PLC                 |   | 27  |   | 207   | 23,561  | 機械                 |   |   |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC      |   | 85  |   | 45    | 5,155   | エネルギー設備・サービス       |   |   |
| INVESCO LTD                        |   | 43  |   | 136   | 15,491  | 資本市場               |   |   |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC           |   | 7   |   | 79    | 9,002   | 医薬品                |   |   |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC |   | 104 |   | 464   | 52,718  | 建設関連製品             |   |   |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A               |   | 24  |   | 70    | 8,055   | メディア               |   |   |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C       |   | 65  |   | 185   | 21,018  | メディア               |   |   |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C       |   | 7   |   | 16    | 1,834   | メディア               |   |   |
| MALLINCKRODT PLC                   |   | 11  |   | 62    | 7,117   | 医薬品                |   |   |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD       |   | 47  |   | 65    | 7,489   | 半導体・半導体製造装置        |   |   |
| MEDTRONIC PLC                      |   | 157 |   | 1,131 | 128,534 | ヘルスケア機器・用品         |   |   |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD          |   | 22  |   | 107   | 12,166  | 繊維・アパレル・贅沢品        |   |   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC               |   | 44  |   | 186   | 21,194  | 専門サービス             |   |   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN       |   | 23  |   | 93    | 10,616  | ホテル・レストラン・レジャー     |   |   |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD         |   | 4   |   | 63    | 7,247   | 保険                 |   |   |
| SEAGATE TECHNOLOGY                 |   | 33  |   | 132   | 15,078  | コンピュータ・周辺機器        |   |   |
| PENTAIR PLC                        |   | 19  |   | 118   | 13,421  | 機械                 |   |   |
| SIGNET JEWELERS LTD                |   | 9   |   | 90    | 10,316  | 専門小売り              |   |   |

| 銘柄                                     |                  | 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     | 千米ドル    | 千円         |                |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC               |                  | 16     | 198     | 22,490     | 保険             |
| PERRIGO CO PLC                         |                  | 16     | 141     | 16,058     | 医薬品            |
| XL GROUP LTD                           |                  | 32     | 115     | 13,157     | 保険             |
| CHUBB LTD                              |                  | 52     | 671     | 76,316     | 保険             |
| GARMIN LTD                             |                  | 15     | 78      | 8,881      | 家庭用耐久財         |
| TE CONNECTIVITY LTD                    |                  | 39     | 270     | 30,737     | 電子装置・機器・部品     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. |                  | 13     | 109     | 12,403     | ソフトウェア         |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD     |                  | 2      | 24      | 2,746      | 医薬品            |
| AERCAP HOLDINGS NV                     |                  | 19     | 82      | 9,396      | 商社・流通業         |
| CORE LABORATORIES N.V.                 |                  | 3      | 45      | 5,137      | エネルギー設備・サービス   |
| MOBILEYE NV                            |                  | 19     | 69      | 7,868      | ソフトウェア         |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A               |                  | 38     | 344     | 39,145     | 化学             |
| MYLAN NV                               |                  | 48     | 171     | 19,435     | 医薬品            |
| NXP SEMICONDUCTORS NV                  |                  | 32     | 315     | 35,879     | 半導体・半導体製造装置    |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING           |                  | 24     | 91      | 10,358     | 電気設備           |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD            |                  | 19     | 156     | 17,766     | ホテル・レストラン・レジャー |
| BROADCOM LTD                           |                  | 44     | 740     | 84,155     | 半導体・半導体製造装置    |
| FLEX LTD                               |                  | 68     | 98      | 11,237     | 電子装置・機器・部品     |
| 小計                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 35,108 | 219,753 | 24,959,608 |                |
|                                        |                  | 603    | —       | <63.2%>    |                |
| (カナダ)                                  |                  |        | 千カナダドル  |            |                |
| ARC RESOURCES LTD                      |                  | 38     | 90      | 7,774      | 石油・ガス・消耗燃料     |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                 |                  | 28     | 151     | 13,005     | 金属・鉱業          |
| AGRIUM INC                             |                  | 15     | 209     | 17,933     | 化学             |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B             |                  | 44     | 266     | 22,812     | 食品・生活必需品小売り    |
| ALTAGAS LTD                            |                  | 15     | 48      | 4,161      | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ATCO LTD CL1                           |                  | 9      | 38      | 3,309      | 総合公益事業         |
| BCE INC                                |                  | 19     | 109     | 9,374      | 各種電気通信サービス     |
| BANK OF MONTREAL                       |                  | 72     | 644     | 55,190     | 銀行             |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX            |                  | 135    | 1,002   | 85,819     | 銀行             |
| BARRICK GOLD                           |                  | 141    | 293     | 25,156     | 金属・鉱業          |
| BLACKBERRY LTD                         |                  | 45     | 45      | 3,889      | コンピュータ・周辺機器    |
| BOMBARDIER B SHEARS                    |                  | 195    | 36      | 3,120      | 航空宇宙・防衛        |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A           |                  | 95     | 410     | 35,166     | 資本市場           |
| CAE INC                                |                  | 34     | 65      | 5,647      | 航空宇宙・防衛        |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B              |                  | 2      | 66      | 5,732      | 容器・包装          |
| CI FINANCIAL CORP                      |                  | 31     | 83      | 7,154      | 資本市場           |
| CAMECO CORP                            |                  | 50     | 64      | 5,540      | 石油・ガス・消耗燃料     |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE     |                  | 43     | 473     | 40,483     | 銀行             |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO               |                  | 87     | 782     | 66,941     | 陸運・鉄道          |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD         |                  | 122    | 551     | 47,186     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD           |                  | 15     | 303     | 25,986     | 陸運・鉄道          |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A               |                  | 6      | 92      | 7,875      | 複合小売り          |
| CANADIAN UTILITIES LTD A               |                  | 10     | 38      | 3,271      | 総合公益事業         |
| CENOVUS ENERGY INC                     |                  | 85     | 175     | 15,041     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC             |                  | 2      | 131     | 11,276     | ソフトウェア         |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP             |                  | 67     | 116     | 9,981      | 石油・ガス・消耗燃料     |
| DOLLARAMA INC                          |                  | 15     | 155     | 13,333     | 複合小売り          |
| ELDORADO GOLD CORPORATION              |                  | 97     | 37      | 3,237      | 金属・鉱業          |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP          |                  | 40     | 47      | 4,032      | 各種金融サービス       |
| EMERA INC                              |                  | 6      | 26      | 2,269      | 電力             |
| EMPIRE CO LTD A                        |                  | 13     | 23      | 2,015      | 食品・生活必需品小売り    |
| ENCANA CORP                            |                  | 97     | 164     | 14,085     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ENBRIDGE INC                           |                  | 104    | 578     | 49,497     | 石油・ガス・消耗燃料     |

| 銘柄                                    | 株数  | 当期末    |         | 業種等            |
|---------------------------------------|-----|--------|---------|----------------|
|                                       |     | 評価額    |         |                |
|                                       |     | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |                |
| (カナダ)                                 | 百株  | 千カナダドル | 千円      |                |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD           | 2   | 163    | 13,955  | 保険             |
| FINNING INTERNATIONAL INC             | 20  | 55     | 4,706   | 商社・流通業         |
| FIRST CAPITAL REALTY INC              | 11  | 22     | 1,895   | 不動産管理・開発       |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD            | 83  | 129    | 11,086  | 金属・鉱業          |
| FORTIS INC                            | 47  | 188    | 16,087  | 電力             |
| FRANCO-NEVADA CORP                    | 22  | 170    | 14,599  | 金属・鉱業          |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                 | 24  | 88     | 7,603   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| GOLDCORP INC                          | 101 | 180    | 15,461  | 金属・鉱業          |
| GREAT-WEST LIFE CO INC                | 34  | 117    | 10,092  | 保険             |
| CGI GROUP INC - CLASS A               | 22  | 137    | 11,730  | 情報技術サービス       |
| HUSKY ENERGY INC                      | 37  | 61     | 5,235   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| HYDRO ONE LTD                         | 29  | 65     | 5,642   | 電力             |
| IGM FINANCIAL INC                     | 13  | 49     | 4,222   | 資本市場           |
| IMPERIAL OIL                          | 39  | 176    | 15,107  | 石油・ガス・消耗燃料     |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC          | 16  | 90     | 7,773   | 保険             |
| INTACT FINANCIAL CORP                 | 14  | 132    | 11,360  | 保険             |
| INTER PIPELINE LTD                    | 38  | 104    | 8,958   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A          | 9   | 18     | 1,625   | 食品・生活必需品小売り    |
| KEYERA CORP                           | 20  | 76     | 6,526   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| KINROSS GOLD CORP                     | 165 | 74     | 6,381   | 金属・鉱業          |
| LINAMAR CORP                          | 5   | 28     | 2,406   | 自動車部品          |
| LOBLAW COMPANIES                      | 23  | 159    | 13,656  | 食品・生活必需品小売り    |
| MAGNA INTERNATIONAL INC               | 41  | 231    | 19,832  | 自動車部品          |
| MANULIFE FINANCIAL CORP               | 218 | 502    | 43,016  | 保険             |
| METHANEX CORP                         | 9   | 56     | 4,868   | 化学             |
| METRO INC                             | 23  | 92     | 7,901   | 食品・生活必需品小売り    |
| NATIONAL BANK OF CANADA               | 35  | 182    | 15,657  | 銀行             |
| ONEX CORPORATION                      | 9   | 84     | 7,234   | 各種金融サービス       |
| OPEN TEXT CORP                        | 14  | 116    | 9,988   | ソフトウェア         |
| PEMBINA PIPELINE CORP                 | 47  | 184    | 15,805  | 石油・ガス・消耗燃料     |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP          | 18  | 61     | 5,238   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC       | 98  | 240    | 20,612  | 化学             |
| POWER CORPORATION OF CANADA           | 51  | 151    | 12,943  | 保険             |
| POWER FINANCIAL CORP                  | 29  | 97     | 8,370   | 保険             |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD                | 18  | 59     | 5,090   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC   | 25  | 160    | 13,699  | ホテル・レストラン・レジャー |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B            | 38  | 194    | 16,619  | 無線通信サービス       |
| ROYAL BANK OF CANADA                  | 168 | 1,477  | 126,391 | 銀行             |
| SNC-LAVALIN GROUP INC                 | 18  | 103    | 8,822   | 建設・土木          |
| SAPUTO INC                            | 28  | 128    | 10,975  | 食品             |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A          | 31  | 95     | 8,212   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B             | 52  | 135    | 11,569  | メディア           |
| SILVER WHEATON CORP                   | 57  | 142    | 12,208  | 金属・鉱業          |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                | 67  | 345    | 29,548  | 保険             |
| SUNCOR ENERGY INC                     | 186 | 801    | 68,582  | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TECK RESOURCES LTD                    | 60  | 206    | 17,702  | 金属・鉱業          |
| TELUS CORP                            | 26  | 109    | 9,386   | 各種電気通信サービス     |
| THOMSON REUTERS CORP                  | 35  | 201    | 17,232  | 資本市場           |
| TORONTO DOMINION BANK                 | 210 | 1,335  | 114,287 | 銀行             |
| TOURMALINE OIL CORP                   | 28  | 104    | 8,917   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TRANSCANADA CORP                      | 95  | 556    | 47,653  | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD          | 87  | 39     | 3,357   | 金属・鉱業          |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 38  | 78     | 6,745   | 医薬品            |
| VERESEN INC                           | 30  | 38     | 3,285   | 石油・ガス・消耗燃料     |

| 銘 柄                           |               | 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    | 千カナダドル 千円    |           |                |
| VERMILION ENERGY INC          |               | 14    | 79           | 6,790     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| WEST FRASER TIMBER            |               | 7     | 38           | 3,251     | 紙製品・林産品        |
| WESTON(GEORGE) LTD            |               | 8     | 89           | 7,655     | 食品・生活必需品小売り    |
| YAMANA GOLD INC               |               | 127   | 50           | 4,357     | 金属・鉱業          |
| YAMANA GOLD INC-RTS           |               | 7     | 0.11895      | 10        | 金属・鉱業          |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額     | 4,613 | 18,198       | 1,557,249 |                |
|                               | 銘 柄 数 < 比 率 > | 92    | —            | < 3.9% >  |                |
| (イギリス)                        |               |       | 千英ポンド        |           |                |
| ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC |               | 103   | 27           | 3,961     | 資本市場           |
| ANTOFAGASTA PLC               |               | 51    | 37           | 5,362     | 金属・鉱業          |
| ASSTEAD GROUP PLC             |               | 61    | 93           | 13,578    | 商社・流通業         |
| BHP BILLITON PLC              |               | 234   | 313          | 45,305    | 金属・鉱業          |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC      |               | 105   | 49           | 7,189     | 家庭用耐久財         |
| SKY PLC                       |               | 104   | 78           | 11,341    | メディア           |
| AVIVA PLC                     |               | 490   | 220          | 31,892    | 保険             |
| DIAGEO PLC                    |               | 283   | 554          | 80,214    | 飲料             |
| SCHRODERS PLC                 |               | 20    | 55           | 8,068     | 資本市場           |
| DCC PLC                       |               | 11    | 70           | 10,207    | コングロマリット       |
| BAE SYSTEMS PLC               |               | 340   | 204          | 29,486    | 航空宇宙・防衛        |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC  |               | 211   | 916          | 132,452   | タバコ            |
| STANDARD CHARTERED PLC        |               | 354   | 227          | 32,890    | 銀行             |
| IMPERIAL BRANDS PLC           |               | 107   | 363          | 52,475    | タバコ            |
| HSBC HOLDINGS PLC             |               | 2,263 | 1,418        | 204,989   | 銀行             |
| LEGAL & GENERAL               |               | 630   | 152          | 22,009    | 保険             |
| MEGGITT PLC                   |               | 96    | 45           | 6,546     | 航空宇宙・防衛        |
| MORRISON SUPERMARKETS         |               | 310   | 68           | 9,839     | 食品・生活必需品小売り    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC  |               | 42    | 108          | 15,662    | 食品             |
| PEARSON                       |               | 88    | 69           | 9,984     | メディア           |
| PERSIMMON PLC                 |               | 38    | 64           | 9,359     | 家庭用耐久財         |
| PRUDENTIAL PLC                |               | 288   | 456          | 65,937    | 保険             |
| RIO TINTO PLC-REG             |               | 138   | 421          | 60,916    | 金属・鉱業          |
| ST JAMES S PLACE PLC          |               | 64    | 60           | 8,695     | 保険             |
| TRAVIS PERKINS PLC            |               | 24    | 32           | 4,707     | 商社・流通業         |
| SSE PLC                       |               | 123   | 180          | 26,134    | 電力             |
| BP PLC                        |               | 2,130 | 990          | 143,144   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC      |               | 7,200 | 419          | 60,620    | 銀行             |
| TATE & LYLE ORD.              |               | 55    | 36           | 5,302     | 食品             |
| TAYLOR WIMPEY PLC             |               | 343   | 51           | 7,515     | 家庭用耐久財         |
| TESCO PLC                     |               | 870   | 184          | 26,709    | 食品・生活必需品小売り    |
| SMITH & NEPHEW PLC            |               | 91    | 100          | 14,560    | ヘルスケア機器・用品     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC           |               | 551   | 803          | 116,197   | 医薬品            |
| WEIR GROUP PLC                |               | 27    | 52           | 7,516     | 機械             |
| BABCOCK INTL GROUP PLC        |               | 33    | 30           | 4,471     | 商業サービス・用品      |
| ASTRAZENECA PLC               |               | 142   | 572          | 82,786    | 医薬品            |
| GKN PLC                       |               | 230   | 70           | 10,219    | 自動車部品          |
| BT GROUP PLC                  |               | 940   | 331          | 47,845    | 各種電気通信サービス     |
| CARNIVAL PLC                  |               | 22    | 88           | 12,843    | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER PLC           |               | 172   | 57           | 8,246     | 複合小売り          |
| BARCLAYS PLC                  |               | 1,890 | 409          | 59,225    | 銀行             |
| INTERTEK GROUP PLC            |               | 21    | 67           | 9,725     | 専門サービス         |
| WILLIAM HILL PLC              |               | 79    | 23           | 3,391     | ホテル・レストラン・レジャー |
| BURBERRY GROUP PLC            |               | 47    | 67           | 9,768     | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEXT PLC                      |               | 17    | 84           | 12,207    | 複合小売り          |
| KINGFISHER PLC                |               | 259   | 90           | 13,083    | 専門小売り          |

| 銘柄                              | 株数    | 当期末   |         | 業種等                     |
|---------------------------------|-------|-------|---------|-------------------------|
|                                 |       | 評価額   |         |                         |
|                                 |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (イギリス)                          | 百株    | 千英ポンド | 千円      |                         |
| ICAP PLC                        | 58    | 28    | 4,058   | 資本市場                    |
| ITV PLC                         | 429   | 72    | 10,485  | メディア                    |
| SAINSBURY                       | 180   | 41    | 6,022   | 食品・生活必需品小売り             |
| RANDGOLD RESOURCES LTD          | 10    | 57    | 8,315   | 金属・鉱業                   |
| G4S PLC                         | 161   | 37    | 5,391   | 商業サービス・用品               |
| ADMIRAL GROUP PLC               | 28    | 51    | 7,430   | 保険                      |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS       | 14    | 39    | 5,670   | 家庭用耐久財                  |
| CENTRICA PLC                    | 670   | 138   | 19,988  | 総合公益事業                  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 490   | 1,006 | 145,473 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B         | 424   | 913   | 132,069 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BUNZLE                          | 41    | 83    | 12,083  | 商社・流通業                  |
| COBHAM PLC                      | 169   | 28    | 4,142   | 航空宇宙・防衛                 |
| NATIONAL GRID PLC               | 420   | 374   | 54,120  | 総合公益事業                  |
| INMARSAT PLC                    | 55    | 38    | 5,513   | 各種電気通信サービス              |
| PETROFAC LTD                    | 34    | 27    | 3,975   | エネルギー設備・サービス            |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC       | 21    | 35    | 5,069   | 医薬品                     |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 35    | 92    | 13,436  | 資本市場                    |
| UNILEVER PLC                    | 144   | 449   | 64,980  | パーソナル用品                 |
| TUI AG-DI                       | 60    | 62    | 9,097   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INVESTECH PLC                   | 62    | 31    | 4,610   | 資本市場                    |
| EXPERIAN PLC                    | 102   | 152   | 22,026  | 専門サービス                  |
| MONDI PLC                       | 39    | 61    | 8,929   | 紙製品・林産品                 |
| SEVERN TRENT PLC                | 27    | 55    | 8,093   | 水道                      |
| WHITBREAD PLC                   | 25    | 85    | 12,314  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 23    | 27    | 3,902   | 資本市場                    |
| SMITHS GROUP PLC                | 47    | 66    | 9,666   | コングロマリット                |
| ANGLO AMERICAN PLC              | 152   | 188   | 27,308  | 金属・鉱業                   |
| 3I GROUP PLC                    | 132   | 90    | 13,107  | 資本市場                    |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC         | 15    | 42    | 6,181   | 消費者金融                   |
| CAPITA PLC                      | 69    | 37    | 5,380   | 専門サービス                  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC     | 70    | 463   | 67,059  | 家庭用品                    |
| RELX PLC                        | 117   | 156   | 22,593  | 専門サービス                  |
| SHIRE PLC                       | 101   | 466   | 67,445  | バイオテクノロジー               |
| FRESNILLO PLC                   | 27    | 31    | 4,487   | 金属・鉱業                   |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC      | 73    | 62    | 9,058   | 水道                      |
| GLENCORE PLC                    | 1,360 | 394   | 57,055  | 金属・鉱業                   |
| DIXONS CARPHONE PLC             | 92    | 31    | 4,547   | 専門小売り                   |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC        | 192   | 127   | 18,468  | 航空宇宙・防衛                 |
| OLD MUTUAL PLC                  | 570   | 106   | 15,447  | 保険                      |
| EASYJET PLC                     | 19    | 18    | 2,676   | 旅客航空輸送業                 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP    | 340   | 67    | 9,720   | 銀行                      |
| SAGE GROUP PLC (THE)            | 130   | 82    | 11,894  | ソフトウェア                  |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC    | 44    | 30    | 4,397   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WPP PLC                         | 139   | 234   | 33,873  | メディア                    |
| COCA-COLA HBC AG-CDI            | 19    | 30    | 4,465   | 飲料                      |
| ROYAL MAIL PLC                  | 125   | 57    | 8,305   | 航空貨物・物流サービス             |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI    | 62    | 26    | 3,859   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WOLSELEY PLC                    | 27    | 126   | 18,287  | 商社・流通業                  |
| IMI PLC                         | 35    | 34    | 5,051   | 機械                      |
| VODAFONE GROUP PLC              | 2,990 | 569   | 82,329  | 無線通信サービス                |
| RSA INSURANCE GROUP PLC         | 122   | 65    | 9,434   | 保険                      |
| COMPASS GROUP PLC               | 180   | 237   | 34,394  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STANDARD LIFE PLC               | 260   | 91    | 13,228  | 保険                      |
| AUTO TRADER GROUP PLC           | 130   | 52    | 7,516   | インターネットソフトウェア・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            |
| (イギリス)                                 |                  | 百株     | 千英ポンド       | 千円        |                   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP            |                  | 120    | 42          | 6,094     | 保険                |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC      |                  | 25     | 81          | 11,718    | ホテル・レストラン・レジャー    |
| WORLDPAY GROUP PLC                     |                  | 200    | 51          | 7,492     | 情報技術サービス          |
| CRODA INTERNATIONAL PLC                |                  | 15     | 48          | 7,070     | 化学                |
| JOHNSON MATTHEY PLC                    |                  | 18     | 55          | 8,047     | 化学                |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC C-ENTITLEMENT |                  | 9,384  | 0.9384      | 135       | 航空宇宙・防衛           |
| 小計                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 42,822 | 19,092      | 2,759,595 |                   |
|                                        |                  | 106    | —           | <7.0%>    |                   |
| (スイス)                                  |                  |        | 千スイスフラン     |           |                   |
| SYNGENTA AG-REG                        |                  | 10     | 403         | 45,467    | 化学                |
| SIKA AG-BR                             |                  | 0.21   | 104         | 11,729    | 化学                |
| SGS SA-REG                             |                  | 0.65   | 131         | 14,880    | 専門サービス            |
| BARRY CALLEBAUT AG                     |                  | 0.22   | 26          | 2,952     | 食品                |
| SWISSCOM AG-REG                        |                  | 2      | 112         | 12,722    | 各種電気通信サービス        |
| LINDT & SPRUENGLI AG-PC                |                  | 0.15   | 74          | 8,391     | 食品                |
| LINDT&SPRUENGLI AG-REG                 |                  | 0.01   | 58          | 6,570     | 食品                |
| GIVAUDAN-REG                           |                  | 1      | 206         | 23,327    | 化学                |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG              |                  | 16     | 444         | 50,094    | 保険                |
| NOVARTIS-REG                           |                  | 254    | 1,765       | 199,072   | 医薬品               |
| ABB LTD                                |                  | 209    | 443         | 50,013    | 電気設備              |
| ROCHE HOLDINGS (GENUSSSCHEINE)         |                  | 79     | 1,774       | 200,119   | 医薬品               |
| ADECCO GROUP AG-REG                    |                  | 18     | 117         | 13,299    | 専門サービス            |
| LAFARGEHOLCIM LTD                      |                  | 49     | 262         | 29,645    | 建設資材              |
| NESTLE SA-REG                          |                  | 349    | 2,373       | 267,625   | 食品                |
| BALOISE HOLDING AG                     |                  | 5      | 72          | 8,162     | 保険                |
| SONOVA HOLDING AG-REG                  |                  | 7      | 86          | 9,720     | ヘルスケア機器・用品        |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG             |                  | 232    | 317         | 35,842    | 資本市場              |
| THE SWATCH GROUP AG-B                  |                  | 3      | 105         | 11,947    | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| THE SWATCH GROUP AG-REG                |                  | 5      | 33          | 3,752     | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| LONZA AG-REG                           |                  | 6      | 120         | 13,572    | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SWISS LIFE HOLDING AG                  |                  | 4      | 111         | 12,589    | 保険                |
| GALENICA AG-REG                        |                  | 0.41   | 43          | 4,951     | 医薬品               |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG              |                  | 1      | 61          | 6,915     | 化学                |
| SWISS PRIME SITE-REG                   |                  | 7      | 59          | 6,759     | 不動産管理・開発          |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES       |                  | 2      | 18          | 2,030     | 各種金融サービス          |
| DUFREY AG-REG                          |                  | 5      | 67          | 7,624     | 専門小売り             |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG              |                  | 2      | 115         | 13,033    | 資本市場              |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT            |                  | 3      | 70          | 7,916     | 機械                |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG               |                  | 2      | 51          | 5,814     | 機械                |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG             |                  | 6      | 82          | 9,356     | 海運業               |
| GEBERIT AG-REG                         |                  | 3      | 156         | 17,666    | 建設関連製品            |
| ACTELION LTD                           |                  | 10     | 210         | 23,772    | バイオテクノロジー         |
| ARYZTA AG                              |                  | 8      | 36          | 4,141     | 食品                |
| JULIUS BAER GROUP LTD                  |                  | 24     | 108         | 12,186    | 資本市場              |
| SWISS RE LTD                           |                  | 35     | 336         | 37,918    | 保険                |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A          |                  | 57     | 380         | 42,874    | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| UBS GROUP AG                           |                  | 410    | 660         | 74,485    | 資本市場              |
| 小計                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,838  | 11,607      | 1,308,947 |                   |
|                                        |                  | 38     | —           | <3.3%>    |                   |
| (スウェーデン)                               |                  |        | 千スウェーデンクローナ |           |                   |
| LUNDBERGS AB-B SHS                     |                  | 4      | 212         | 2,639     | 各種金融サービス          |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB       |                  | 191    | 1,754       | 21,823    | 銀行                |
| SWEDBANK AB                            |                  | 98     | 2,100       | 26,125    | 銀行                |
| SWEDISH MATCH AB                       |                  | 23     | 658         | 8,188     | タバコ               |

| 銘柄                                  |                  | 当期未         |             | 業種等               |             |
|-------------------------------------|------------------|-------------|-------------|-------------------|-------------|
|                                     |                  | 株数          | 評価額         |                   |             |
|                                     |                  |             | 外貨建金額       |                   | 邦貨換算金額      |
| (スウェーデン)                            |                  | 百株          | 千スウェーデンクローナ | 千円                |             |
| NORDEA BANK AB                      |                  | 335         | 3,244       | 40,361            | 銀行          |
| SECURITAS AB-B SHS                  |                  | 44          | 586         | 7,301             | 商業サービス・用品   |
| INVESTOR AB-B SHS                   |                  | 47          | 1,486       | 18,487            | 各種金融サービス    |
| HENNES&MAURITZ AB-B                 |                  | 104         | 2,778       | 34,569            | 専門小売り       |
| ERICSSON LM-B                       |                  | 330         | 1,597       | 19,869            | 通信機器        |
| TELIA CO AB                         |                  | 291         | 995         | 12,384            | 各種電気通信サービス  |
| SKANSKA AB-B SHS                    |                  | 46          | 977         | 12,160            | 建設・土木       |
| LUNDIN PETROLEUM AB                 |                  | 24          | 431         | 5,368             | 石油・ガス・消耗燃料  |
| ALFA LAVAL AB                       |                  | 30          | 417         | 5,187             | 機械          |
| GETINGE AB-B SHS                    |                  | 25          | 344         | 4,288             | ヘルスケア機器・用品  |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR |                  | 5           | 218         | 2,712             | 無線通信サービス    |
| ICA GRUPPEN AB                      |                  | 9           | 241         | 3,009             | 食品・生活必需品小売り |
| HUSQVARNA AB-B SHS                  |                  | 46          | 310         | 3,865             | 家庭用耐久財      |
| ELECTROLUX AB-B                     |                  | 26          | 547         | 6,808             | 家庭用耐久財      |
| SKF AB-B SHARES                     |                  | 41          | 709         | 8,823             | 機械          |
| VOLVO AB-B SHS                      |                  | 183         | 1,886       | 23,470            | 機械          |
| SANDVIK AB                          |                  | 111         | 1,222       | 15,203            | 機械          |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS             |                  | 20          | 325         | 4,045             | 各種金融サービス    |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B              |                  | 65          | 1,550       | 19,285            | 家庭用品        |
| BOLIDEN AB                          |                  | 26          | 644         | 8,021             | 金属・鉱業       |
| HEXAGON AB-B SHS                    |                  | 34          | 1,083       | 13,483            | 電子装置・機器・部品  |
| TELE 2 AB-B SHS                     |                  | 42          | 285         | 3,555             | 無線通信サービス    |
| KINNEVIK AB - B                     |                  | 23          | 514         | 6,394             | 各種金融サービス    |
| ATLAS COPCO AB-A                    |                  | 83          | 2,328       | 28,972            | 機械          |
| ATLAS COPCO AB-B                    |                  | 45          | 1,122       | 13,967            | 機械          |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A             |                  | 164         | 2,120       | 26,379            | 銀行          |
| ASSA ABLOY AB-B                     |                  | 122         | 2,026       | 25,208            | 建設関連製品      |
| 小計                                  | 株数・金額<br>銘柄数＜比率＞ | 2,637<br>31 | 34,723<br>— | 431,963<br>＜1.1％＞ |             |
| (ノルウェー)                             |                  |             | 千ノルウェークローネ  |                   |             |
| DNB ASA                             |                  | 102         | 1,305       | 17,677            | 銀行          |
| TELENOR ASA                         |                  | 96          | 1,196       | 16,196            | 各種電気通信サービス  |
| SCHIBSTED ASA                       |                  | 8           | 141         | 1,917             | メディア        |
| STATOIL ASA                         |                  | 132         | 1,966       | 26,630            | 石油・ガス・消耗燃料  |
| YARA INTERNATIONAL ASA              |                  | 17          | 535         | 7,248             | 化学          |
| MARINE HARVEST ASA                  |                  | 36          | 547         | 7,409             | 食品          |
| NORSK HYDRO                         |                  | 142         | 573         | 7,767             | 金属・鉱業       |
| ORKLA ASA                           |                  | 94          | 711         | 9,634             | 食品          |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA           |                  | 26          | 352         | 4,777             | 保険          |
| SCHIBSTED ASA-B SHS                 |                  | 9           | 151         | 2,054             | メディア        |
| 小計                                  | 株数・金額<br>銘柄数＜比率＞ | 662<br>10   | 7,482<br>—  | 101,313<br>＜0.3％＞ |             |
| (デンマーク)                             |                  |             | 千デンマーククローネ  |                   |             |
| CARLSBERG B                         |                  | 10          | 619         | 10,158            | 飲料          |
| A P MOLLER-MAERSK A/S               |                  | 0.78        | 787         | 12,927            | 海運業         |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A           |                  | 0.5         | 482         | 7,909             | 海運業         |
| DANSKE BANK AS                      |                  | 73          | 1,498       | 24,593            | 銀行          |
| GENMAB A/S                          |                  | 7           | 906         | 14,878            | バイオテクノロジー   |
| TDC A/S                             |                  | 82          | 276         | 4,532             | 各種電気通信サービス  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S             |                  | 28          | 1,233       | 20,245            | 電気設備        |
| DSV A/S                             |                  | 24          | 734         | 12,047            | 陸運・鉄道       |
| PANDORA A/S                         |                  | 11          | 960         | 15,761            | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHR HANSEN HOLDING A/S              |                  | 10          | 382         | 6,276             | 化学          |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES              |                  | 24          | 562         | 9,230             | 化学          |

| 銘柄                           | 株数  | 当期末        |         | 業 種 等                   |
|------------------------------|-----|------------|---------|-------------------------|
|                              |     | 外貨建金額      | 邦貨換算金額  |                         |
| (デンマーク)                      | 百株  | 千デンマーククローネ | 千円      |                         |
| COLOPLAST-B                  | 12  | 564        | 9,269   | ヘルスケア機器・用品              |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 215 | 5,138      | 84,322  | 医薬品                     |
| ISS A/S                      | 19  | 447        | 7,336   | 商業サービス・用品               |
| TRYG A/S                     | 10  | 126        | 2,074   | 保険                      |
| DONG ENERGY A/S              | 10  | 234        | 3,844   | 電力                      |
| WILLIAM DEMANT HOLDING       | 13  | 150        | 2,466   | ヘルスケア機器・用品              |
| 小 計                          | 552 | 15,105     | 247,875 |                         |
| 銘柄数・金額<br>銘柄数<比率>            | 17  | —          | <0.6%>  |                         |
| (ユーロ…ドイツ)                    |     | 千ユーロ       |         |                         |
| ADIDAS AG                    | 20  | 291        | 35,637  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 44  | 298        | 36,483  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 15  | 54         | 6,678   | インターネットソフトウェア・サービス      |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD       | 7   | 27         | 3,390   | 化学                      |
| HANNOVER RUECK SE            | 7   | 79         | 9,647   | 保険                      |
| GEA GROUP AG                 | 17  | 59         | 7,325   | 機械                      |
| CONTINENTAL AG               | 13  | 227        | 27,781  | 自動車部品                   |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 105 | 307        | 37,532  | 航空貨物・物流サービス             |
| AXEL SPRINGER SE             | 3   | 14         | 1,761   | メディア                    |
| MERCK KGAA                   | 16  | 152        | 18,676  | 医薬品                     |
| RWE AG                       | 58  | 68         | 8,417   | 総合公益事業                  |
| SAP SE                       | 111 | 858        | 104,779 | ソフトウェア                  |
| E.ON SE                      | 247 | 151        | 18,508  | 総合公益事業                  |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 13  | 124        | 15,238  | 家庭用品                    |
| METRO AG                     | 17  | 48         | 5,861   | 食品・生活必需品小売り             |
| BAYER AG-REG                 | 93  | 822        | 100,419 | 医薬品                     |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 21  | 231        | 28,310  | 家庭用品                    |
| BASF SE                      | 103 | 859        | 104,966 | 化学                      |
| BEIERSDORF AG                | 13  | 104        | 12,699  | パーソナル用品                 |
| HOCHTIEF AG                  | 1   | 21         | 2,648   | 建設・土木                   |
| HEIDELBERGCEMENT AG          | 18  | 154        | 18,825  | 建設資材                    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE       | 22  | 164        | 20,060  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE-REG               | 51  | 778        | 95,076  | 保険                      |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 34  | 41         | 5,075   | 旅客航空輸送業                 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 17  | 304        | 37,182  | 保険                      |
| VOLKSWAGEN AG                | 3   | 48         | 5,873   | 自動車                     |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 20  | 245        | 29,991  | 自動車                     |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 108 | 691        | 84,487  | 自動車                     |
| MAN SE                       | 4   | 40         | 4,911   | 機械                      |
| THYSSENKRUPP AG              | 50  | 109        | 13,391  | 金属・鉱業                   |
| SIEMENS AG                   | 86  | 942        | 115,121 | コングロマリット                |
| QIAGEN NV                    | 22  | 58         | 7,105   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| LINDE AG                     | 20  | 318        | 38,844  | 化学                      |
| DEUTSCHE BANK AG-REG         | 149 | 227        | 27,798  | 資本市場                    |
| BAYER MOTOREN WERK           | 36  | 299        | 36,622  | 自動車                     |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 7   | 51         | 6,256   | 自動車                     |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG         | 367 | 546        | 66,767  | 各種電気通信サービス              |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 122 | 192        | 23,506  | 半導体・半導体製造装置             |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 16  | 77         | 9,495   | 自動車                     |
| FRAPORT AG                   | 3   | 20         | 2,511   | 運送インフラ                  |
| LANXESS                      | 9   | 57         | 7,004   | 化学                      |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR        | 43  | 120        | 14,685  | 不動産管理・開発                |
| SYMRISE AG                   | 15  | 82         | 10,101  | 化学                      |
| BRENNTAG AG                  | 19  | 92         | 11,336  | 商社・流通業                  |
| K+S AG                       | 24  | 48         | 5,910   | 化学                      |

| 銘 柄                                 |               | 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    | 千ユーロ         | 千円        |                |
| EVONIK INDUSTRIES AG                |               | 18    | 46           | 5,671     | 化学             |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG   |               | 110   | 41           | 5,067     | 各種電気通信サービス     |
| HUGO BOSS AG                        |               | 7     | 38           | 4,745     | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| COMMERZBANK AG                      |               | 123   | 81           | 9,895     | 銀行             |
| OSRAM LICHT AG                      |               | 8     | 38           | 4,728     | 電気設備           |
| VONOVIA SE                          |               | 49    | 143          | 17,544    | 不動産管理・開発       |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE            |               | 27    | 86           | 10,600    | メディア           |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER           |               | 20    | 148          | 18,099    | 資本市場           |
| INNOGY SE                           |               | 16    | 49           | 6,020     | 総合公益事業         |
| ZALANDO SE                          |               | 9     | 31           | 3,808     | インターネット販売・通信販売 |
| COVESTRO AG                         |               | 11    | 68           | 8,382     | 化学             |
| SCHAEFFLER AG                       |               | 13    | 15           | 1,928     | 自動車部品          |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 2,615 | 11,312       | 1,381,203 |                |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 57    | —            | <3.5%>    |                |
| (ユーロ…イタリア)                          |               |       |              |           |                |
| ASSICURAZIONI GENERALI              |               | 130   | 158          | 19,365    | 保険             |
| INTESA SANPAOLO                     |               | 1,390 | 293          | 35,776    | 銀行             |
| INTESA SANPAOLO-RSP                 |               | 140   | 27           | 3,299     | 銀行             |
| MEDIOBANCA S. P. A.                 |               | 56    | 36           | 4,403     | 銀行             |
| SAIPEM SPA                          |               | 736   | 32           | 3,961     | エネルギー設備・サービス   |
| LUXOTTICA GROUP SPA                 |               | 22    | 110          | 13,525    | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| ENEL SPA                            |               | 840   | 314          | 38,399    | 電力             |
| ENI SPA                             |               | 277   | 379          | 46,301    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| SNAM SPA                            |               | 310   | 108          | 13,209    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TENARIS SA                          |               | 56    | 89           | 10,899    | エネルギー設備・サービス   |
| TELECOM ITALIA SPA                  |               | 1,120 | 78           | 9,572     | 各種電気通信サービス     |
| TELECOM ITALIA-RNC                  |               | 680   | 38           | 4,711     | 各種電気通信サービス     |
| ATLANTIA SPA                        |               | 54    | 110          | 13,523    | 運送インフラ         |
| TERNA SPA                           |               | 163   | 64           | 7,861     | 電力             |
| EXOR SPA                            |               | 13    | 50           | 6,198     | 各種金融サービス       |
| LEONARDO-FINMECCANICA SPA           |               | 42    | 53           | 6,579     | 航空宇宙・防衛        |
| PRYSMIAN SPA                        |               | 27    | 63           | 7,750     | 電気設備           |
| UNICREDIT SPA                       |               | 680   | 136          | 16,721    | 銀行             |
| UNIPOLSAI SPA                       |               | 80    | 14           | 1,780     | 保険             |
| FERRARI NV                          |               | 12    | 61           | 7,567     | 自動車            |
| CNH INDUSTRIAL NV                   |               | 101   | 84           | 10,291    | 機械             |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV        |               | 85    | 64           | 7,820     | 自動車            |
| POSTE ITALIANE SPA                  |               | 79    | 46           | 5,657     | 保険             |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 7,093 | 2,417        | 295,178   |                |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 23    | —            | <0.7%>    |                |
| (ユーロ…フランス)                          |               |       |              |           |                |
| BOUYGUES                            |               | 21    | 67           | 8,245     | 建設・土木          |
| AIRBUS GROUP SE                     |               | 64    | 383          | 46,792    | 航空宇宙・防衛        |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                |               | 51    | 78           | 9,633     | 総合公益事業         |
| LOREAL-ORD                          |               | 28    | 447          | 54,587    | パーソナル用品        |
| CHRISTIAN DIOR SE                   |               | 5     | 103          | 12,652    | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE |               | 31    | 535          | 65,389    | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| DASSAULT AVIATION SA                |               | 0.26  | 26           | 3,283     | 航空宇宙・防衛        |
| THALES SA                           |               | 13    | 128          | 15,690    | 航空宇宙・防衛        |
| CAP GEMINI SA                       |               | 20    | 146          | 17,934    | 情報技術サービス       |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA        |               | 7     | 29           | 3,595     | 食品・生活必需品小売り    |
| INGENICO GROUP                      |               | 6     | 48           | 5,979     | 電子装置・機器・部品     |
| PUBLICIS GROUPE                     |               | 23    | 145          | 17,710    | メディア           |
| LAGARDERE S. C. A                   |               | 9     | 22           | 2,689     | メディア           |

| 銘柄                          | 柄 | 当 期 末 |       |         | 業 種 等          |
|-----------------------------|---|-------|-------|---------|----------------|
|                             |   | 株 数   | 評 価 額 |         |                |
|                             |   |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                |
| (ユーロ…フランス)                  |   | 百株    | 千ユーロ  | 千円      |                |
| BOLLORE                     |   | 75    | 23    | 2,832   | 航空貨物・物流サービス    |
| MICHELIN (CGDE)             |   | 19    | 198   | 24,230  | 自動車部品          |
| PERNOD RICARD SA            |   | 26    | 253   | 30,895  | 飲料             |
| RENAULT SA                  |   | 20    | 154   | 18,909  | 自動車            |
| REMY COINTREAU              |   | 3     | 26    | 3,235   | 飲料             |
| SEB SA                      |   | 2     | 33    | 4,077   | 家庭用耐久財         |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE       |   | 62    | 394   | 48,184  | 電気設備           |
| VIVENDI SA                  |   | 111   | 196   | 23,934  | メディア           |
| TECHNIP SA                  |   | 12    | 83    | 10,207  | エネルギー設備・サービス   |
| ORANGE SA                   |   | 219   | 289   | 35,403  | 各種電気通信サービス     |
| HERMES INTERNATIONAL        |   | 3     | 132   | 16,159  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| SOCIETE BIC SA              |   | 3     | 36    | 4,413   | 商業サービス・用品      |
| DASSAULT SYSTEMES SA        |   | 14    | 98    | 12,027  | ソフトウェア         |
| KERING SA                   |   | 8     | 165   | 20,254  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| CNP ASSURANCES              |   | 16    | 27    | 3,418   | 保険             |
| CARREFOUR SUPERMARCHE       |   | 70    | 153   | 18,735  | 食品・生活必需品小売り    |
| ATOS SE                     |   | 8     | 85    | 10,483  | 情報技術サービス       |
| SANOFI                      |   | 131   | 998   | 121,937 | 医薬品            |
| ACCOR SA                    |   | 21    | 71    | 8,763   | ホテル・レストラン・レジャー |
| STMICROELECTRONICS NV       |   | 59    | 56    | 6,889   | 半導体・半導体製造装置    |
| SOCIETE GENERALE            |   | 85    | 347   | 42,448  | 銀行             |
| EURAZEO                     |   | 3     | 15    | 1,910   | 各種金融サービス       |
| SODEXO                      |   | 10    | 108   | 13,192  | ホテル・レストラン・レジャー |
| AXA                         |   | 216   | 491   | 60,065  | 保険             |
| PEUGEOT CITROEN             |   | 52    | 74    | 9,073   | 自動車            |
| JC DECAUX SA                |   | 7     | 18    | 2,230   | メディア           |
| ESSILOR INTERNATIONAL       |   | 24    | 245   | 29,977  | ヘルスケア機器・用品     |
| CREDIT AGRICOLE SA          |   | 141   | 153   | 18,688  | 銀行             |
| ZODIAC AEROSPACE            |   | 18    | 39    | 4,775   | 航空宇宙・防衛        |
| BNP PARIBAS                 |   | 119   | 658   | 80,350  | 銀行             |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)  |   | 53    | 216   | 26,396  | 建設関連製品         |
| WENDEL                      |   | 2     | 29    | 3,544   | 各種金融サービス       |
| ILIAD SA                    |   | 3     | 53    | 6,497   | 各種電気通信サービス     |
| SES FDR                     |   | 39    | 77    | 9,423   | メディア           |
| IMERYS                      |   | 4     | 29    | 3,607   | 建設資材           |
| SAFRAN SA                   |   | 38    | 250   | 30,541  | 航空宇宙・防衛        |
| ENGIE                       |   | 178   | 205   | 25,037  | 総合公益事業         |
| ALSTOM                      |   | 19    | 48    | 5,887   | 機械             |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS     |   | 22    | 37    | 4,528   | メディア           |
| ELECTRICITE DE FRANCE       |   | 22    | 22    | 2,769   | 電力             |
| ARKEMA                      |   | 8     | 76    | 9,313   | 化学             |
| LEGRAND SA                  |   | 28    | 146   | 17,846  | 電気設備           |
| EIFFAGE SA                  |   | 8     | 52    | 6,392   | 建設・土木          |
| TOTAL SA                    |   | 255   | 1,146 | 139,954 | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ADP                         |   | 2     | 26    | 3,262   | 運送インフラ         |
| NATIXIS                     |   | 110   | 54    | 6,660   | 銀行             |
| SCOR SE                     |   | 24    | 72    | 8,794   | 保険             |
| REXEL SA                    |   | 37    | 56    | 6,892   | 商社・流通業         |
| VINCI                       |   | 55    | 332   | 40,642  | 建設・土木          |
| DANONE                      |   | 66    | 386   | 47,231  | 食品             |
| AIR LIQUIDE                 |   | 43    | 416   | 50,806  | 化学             |
| BUREAU VERITAS SA           |   | 31    | 54    | 6,667   | 専門サービス         |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR |   | 65    | 54    | 6,657   | 運送インフラ         |
| SUEZ                        |   | 36    | 45    | 5,613   | 総合公益事業         |

| 銘柄                                   |                  | 株数    | 当期末    |           | 業種等         |
|--------------------------------------|------------------|-------|--------|-----------|-------------|
|                                      |                  |       | 評価額    |           |             |
|                                      |                  |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |             |
| (ユーロ…フランス)                           |                  | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |             |
| EDENRED                              |                  | 18    | 35     | 4,306     | 商業サービス・用品   |
| VALEO SA                             |                  | 29    | 157    | 19,216    | 自動車部品       |
| SFR GROUP SA                         |                  | 12    | 27     | 3,305     | 各種電気通信サービス  |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,059 | 11,905 | 1,453,688 |             |
| (ユーロ…イギリス)                           |                  |       |        |           |             |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS          |                  | 24    | 71     | 8,693     | 飲料          |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 24    | 71     | 8,693     |             |
| (ユーロ…オランダ)                           |                  |       |        |           |             |
| RELX NV                              |                  | 106   | 158    | 19,375    | 専門サービス      |
| RANDSTAD HOLDING NV                  |                  | 16    | 77     | 9,420     | 専門サービス      |
| AKZO NOBEL                           |                  | 31    | 178    | 21,734    | 化学          |
| WOLTERS KLUWER                       |                  | 39    | 127    | 15,552    | 専門サービス      |
| VOPAK                                |                  | 7     | 29     | 3,549     | 石油・ガス・消耗燃料  |
| AEGON NV                             |                  | 180   | 89     | 10,870    | 保険          |
| KONINKLIJKE KPN NV                   |                  | 430   | 111    | 13,556    | 各種電気通信サービス  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV               |                  | 102   | 273    | 33,439    | コングロマリット    |
| HEINEKEN NV                          |                  | 28    | 193    | 23,569    | 飲料          |
| ARCELORMITTAL                        |                  | 192   | 144    | 17,636    | 金属・鉱業       |
| HEINEKEN HOLDING NV                  |                  | 11    | 70     | 8,595     | 飲料          |
| KONINKLIJKE DSM NV                   |                  | 19    | 107    | 13,093    | 化学          |
| UNILEVER NV-CVA                      |                  | 183   | 681    | 83,266    | パーソナル用品     |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA             |                  | 12    | 35     | 4,360     | 建設・土木       |
| ASML HOLDING NV                      |                  | 40    | 390    | 47,696    | 半導体・半導体製造装置 |
| GEMALTO                              |                  | 8     | 38     | 4,688     | ソフトウェア      |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV        |                  | 140   | 259    | 31,709    | 食品・生活必需品小売り |
| NN GROUP NV                          |                  | 40    | 122    | 14,920    | 保険          |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA                |                  | 26    | 52     | 6,439     | 銀行          |
| ALTICE NV - B                        |                  | 9     | 14     | 1,715     | メディア        |
| ALTICE NV - A                        |                  | 49    | 76     | 9,333     | メディア        |
| ING GROEP NV                         |                  | 434   | 560    | 68,438    | 銀行          |
| 小計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,103 | 3,791  | 462,961   |             |
| (ユーロ…スペイン)                           |                  |       |        |           |             |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA          |                  | 67    | 84     | 10,371    | 運送インフラ      |
| ENDESA S.A.                          |                  | 35    | 67     | 8,224     | 電力          |
| BANKINTER S.A.                       |                  | 82    | 59     | 7,206     | 銀行          |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. |                  | 730   | 426    | 52,116    | 銀行          |
| GAS NATURAL SDG                      |                  | 44    | 71     | 8,671     | ガス          |
| REPSOL SA                            |                  | 114   | 147    | 17,962    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| BANCO SANTANDER SA                   |                  | 1,640 | 713    | 87,106    | 銀行          |
| TELEFONICA SA                        |                  | 495   | 383    | 46,793    | 各種電気通信サービス  |
| TELEFONICA S.A.-RIGHTS               |                  | 532   | 16     | 2,008     | 各種電気通信サービス  |
| ZARDOYA OTIS S.A                     |                  | 18    | 13     | 1,656     | 機械          |
| ENAGAS                               |                  | 31    | 71     | 8,673     | ガス          |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV         |                  | 22    | 63     | 7,733     | 建設・土木       |
| FERROVIAL SA                         |                  | 61    | 100    | 12,286    | 建設・土木       |
| MAPFRE SA                            |                  | 127   | 36     | 4,490     | 保険          |
| BANCO DE SABADELL SA                 |                  | 740   | 90     | 11,095    | 銀行          |
| CAIXABANK                            |                  | 440   | 125    | 15,365    | 銀行          |
| CAIXABANK-RIGHTS                     |                  | 440   | 1      | 209       | 銀行          |
| IBERDROLA SA                         |                  | 600   | 334    | 40,886    | 電力          |
| AMADEUS IT GROUP SA                  |                  | 47    | 196    | 23,999    | 情報技術サービス    |

| 銘 柄                                     |              | 当 期 末 |              | 業 種 等   |                   |
|-----------------------------------------|--------------|-------|--------------|---------|-------------------|
|                                         |              | 株 数   | 評 価 額        |         |                   |
|                                         |              |       | 外貨建金額 邦貨換算金額 |         |                   |
| (ユーロ…スペイン)                              |              | 百株    | 千ユーロ         | 千円      |                   |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP |              | 100   | 48           | 5,980   | 旅客航空輸送業           |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL             |              | 54    | 22           | 2,794   | 食品・生活必需品小売り       |
| BANKIA SA                               |              | 490   | 41           | 5,025   | 銀行                |
| BCO POPULAR ESPANOL                     |              | 357   | 32           | 4,014   | 銀行                |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA            |              | 42    | 69           | 8,435   | 電力                |
| INDITEX SA                              |              | 121   | 386          | 47,247  | 専門小売り             |
| AENA SA                                 |              | 8     | 111          | 13,654  | 運送インフラ            |
| GRIFOLS SA                              |              | 36    | 61           | 7,479   | バイオテクノロジー         |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 7,476 | 3,779        | 461,489 |                   |
|                                         | 銘柄 数 < 比 率 > | 27    | —            | <1.2%>  |                   |
| (ユーロ…ベルギー)                              |              |       |              |         |                   |
| UMICORE                                 |              | 8     | 44           | 5,381   | 化学                |
| KBC GROEP NV                            |              | 26    | 150          | 18,365  | 銀行                |
| SOLVAY SA                               |              | 9     | 96           | 11,818  | 化学                |
| UCB SA                                  |              | 13    | 76           | 9,333   | 医薬品               |
| COLRUYT SA                              |              | 9     | 45           | 5,545   | 食品・生活必需品小売り       |
| GROUPE BRUXELLES LAM                    |              | 10    | 75           | 9,258   | 各種金融サービス          |
| PROXIMUS                                |              | 15    | 40           | 4,898   | 各種電気通信サービス        |
| TELENET GROUP HOLDING NV                |              | 6     | 34           | 4,154   | メディア              |
| AGEAS                                   |              | 27    | 96           | 11,774  | 保険                |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV              |              | 86    | 827          | 101,015 | 飲料                |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 210   | 1,486        | 181,546 |                   |
|                                         | 銘柄 数 < 比 率 > | 10    | —            | <0.5%>  |                   |
| (ユーロ…オーストリア)                            |              |       |              |         |                   |
| OMV AG                                  |              | 21    | 63           | 7,798   | 石油・ガス・消耗燃料        |
| VOESTALPINE AG                          |              | 12    | 43           | 5,347   | 金属・鉱業             |
| ERSTE GROUP BANK AG                     |              | 29    | 77           | 9,420   | 銀行                |
| IMMOEAST AG-RIGHTS                      |              | 83    | —            | —       | 不動産管理・開発          |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG        |              | 15    | 25           | 3,138   | 銀行                |
| ANDRITZ AG                              |              | 7     | 33           | 4,099   | 機械                |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 167   | 244          | 29,804  |                   |
|                                         | 銘柄 数 < 比 率 > | 6     | —            | <0.1%>  |                   |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)                           |              |       |              |         |                   |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE                  |              | 1     | 52           | 6,381   | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| RTL GROUP                               |              | 3     | 20           | 2,451   | メディア              |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 4     | 72           | 8,833   |                   |
|                                         | 銘柄 数 < 比 率 > | 2     | —            | <0.0%>  |                   |
| (ユーロ…フィンランド)                            |              |       |              |         |                   |
| WARTSILA OYJ                            |              | 16    | 64           | 7,888   | 機械                |
| UPM-KYMMENE OYJ                         |              | 69    | 148          | 18,138  | 紙製品・林産品           |
| STORA ENSO OYJ-R                        |              | 49    | 44           | 5,447   | 紙製品・林産品           |
| SAMPO OYJ-A SHS                         |              | 47    | 196          | 23,976  | 保険                |
| FORTUM OYJ                              |              | 51    | 69           | 8,524   | 電力                |
| ELISA OYJ                               |              | 16    | 46           | 5,655   | 各種電気通信サービス        |
| METSO OYJ                               |              | 15    | 40           | 4,968   | 機械                |
| NOKIA OYJ                               |              | 640   | 263          | 32,195  | 通信機器              |
| NESTE OYJ                               |              | 19    | 72           | 8,901   | 石油・ガス・消耗燃料        |
| NOKIAN RENKAAT OYJ                      |              | 11    | 38           | 4,718   | 自動車部品             |
| KONE OYJ                                |              | 36    | 148          | 18,127  | 機械                |
| ORION OYJ                               |              | 10    | 39           | 4,848   | 医薬品               |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額    | 979   | 1,174        | 143,391 |                   |
|                                         | 銘柄 数 < 比 率 > | 12    | —            | <0.4%>  |                   |
| (ユーロ…アイルランド)                            |              |       |              |         |                   |
| BANK OF IRELAND                         |              | 4,000 | 89           | 10,940  | 銀行                |

| 銘柄                                 |              | 株数     |        | 当 期 末     |                | 業 種 等 |
|------------------------------------|--------------|--------|--------|-----------|----------------|-------|
|                                    |              |        |        | 評 価 額     |                |       |
|                                    |              |        |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額         |       |
| (ユーロ…アイルランド)                       |              | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                |       |
| CRH PLC                            |              | 91     | 280    | 34,249    | 建設資材           |       |
| KERRY GROUP PLC-A                  |              | 19     | 122    | 14,912    | 食品             |       |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD     |              | 134    | —      | —         | 銀行             |       |
| PADDY POWER PLC                    |              | 9      | 95     | 11,627    | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 4,253  | 587    | 71,730    |                |       |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 5      | —      | <0.2%>    |                |       |
| (ユーロ…ポルトガル)                        |              |        |        |           |                |       |
| ENERGIAS DE PORTUGAL               |              | 238    | 64     | 7,831     | 電力             |       |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS        |              | 58     | 76     | 9,347     | 石油・ガス・消耗燃料     |       |
| JERONIMO MARTINS                   |              | 38     | 55     | 6,806     | 食品・生活必需品小売り    |       |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 334    | 196    | 23,986    |                |       |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 3      | —      | <0.1%>    |                |       |
| ユ ー ロ 計                            | 株 数 ・ 金 額    | 28,321 | 37,039 | 4,522,506 |                |       |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 238    | —      | <11.4%>   |                |       |
| (香港)                               |              |        | 千香港ドル  |           |                |       |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY             |              | 32     | 239    | 3,506     | 半導体・半導体製造装置    |       |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD           |              | 220    | 373    | 5,472     | 不動産管理・開発       |       |
| BANK OF EAST ASIA                  |              | 115    | 368    | 5,393     | 銀行             |       |
| CLP HLDGS                          |              | 170    | 1,261  | 18,479    | 電力             |       |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS             |              | 170    | 177    | 2,600     | 旅客航空輸送業        |       |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE         |              | 80     | 515    | 7,553     | 電力             |       |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD |              | 125    | 2,467  | 36,148    | 資本市場           |       |
| LI & FUNG LTD                      |              | 620    | 207    | 3,042     | 繊維・アパレル・贅沢品    |       |
| MTR CORP                           |              | 190    | 722    | 10,591    | 陸運・鉄道          |       |
| FIRST PACIFIC CO                   |              | 320    | 174    | 2,550     | 各種金融サービス       |       |
| HANG LUNG GROUP LTD                |              | 100    | 284    | 4,160     | 不動産管理・開発       |       |
| HANG SENG BANK                     |              | 90     | 1,314  | 19,263    | 銀行             |       |
| HENDERSON LAND                     |              | 148    | 628    | 9,210     | 不動産管理・開発       |       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD          |              | 145    | 1,044  | 15,294    | 電力             |       |
| WHARF (HOLDING)                    |              | 172    | 954    | 13,984    | 不動産管理・開発       |       |
| HONG KONG & CHINA GAS              |              | 802    | 1,131  | 16,577    | ガス             |       |
| HYSAN DEVELOPMENT                  |              | 70     | 239    | 3,502     | 不動産管理・開発       |       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L       |              | 240    | 879    | 12,886    | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| KERRY PROPERTIES                   |              | 65     | 140    | 2,052     | 不動産管理・開発       |       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         |              | 390    | 1,117  | 16,369    | 銀行             |       |
| NWS HOLDINGS LTD                   |              | 190    | 248    | 3,635     | コングロマリット       |       |
| PCCW LTD                           |              | 410    | 184    | 2,708     | 各種電気通信サービス     |       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG           |              | 55     | 159    | 2,340     | 繊維・アパレル・贅沢品    |       |
| NEW WORLD DEVELOPMENT              |              | 663    | 572    | 8,386     | 不動産管理・開発       |       |
| SHANGRI-LA ASIA LTD                |              | 190    | 163    | 2,391     | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| SINO LAND CO.LTD                   |              | 310    | 362    | 5,313     | 不動産管理・開発       |       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES            |              | 160    | 1,624  | 23,791    | 不動産管理・開発       |       |
| SWIRE PACIFIC-A                    |              | 70     | 535    | 7,845     | 不動産管理・開発       |       |
| WHEELOCK & COMPANY LTD             |              | 80     | 363    | 5,326     | 不動産管理・開発       |       |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO           |              | 120    | 357    | 5,238     | 家庭用耐久財         |       |
| SJM HOLDINGS LIMITED               |              | 240    | 147    | 2,165     | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| WYNN MACAU LTD                     |              | 180    | 245    | 3,591     | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD             |              | 136    | 226    | 3,311     | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| AIA GROUP LTD                      |              | 1,360  | 6,194  | 90,753    | 保険             |       |
| HKT TRUST AND HKT LTD              |              | 381    | 378    | 5,551     | 各種電気通信サービス     |       |
| SANDS CHINA LTD                    |              | 280    | 1,043  | 15,279    | ホテル・レストラン・レジャー |       |
| SWIRE PROPERTIES LTD               |              | 108    | 243    | 3,559     | 不動産管理・開発       |       |
| WH GROUP LIMITED                   |              | 1,140  | 723    | 10,605    | 食品             |       |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD          |              | 299    | 2,794  | 40,934    | コングロマリット       |       |

| 銘 柄                                  |               | 当 期 末  |           |         | 業 種 等                   |
|--------------------------------------|---------------|--------|-----------|---------|-------------------------|
|                                      |               | 株 数    | 評 価 額     |         |                         |
|                                      |               |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |                         |
| (香港)                                 |               | 百株     | 千香港ドル     | 千円      |                         |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING         |               | 289    | 1,474     | 21,604  | 不動産管理・開発                |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 10,927 | 32,284    | 472,974 |                         |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 40     | —         | <1.2%>  |                         |
| (シンガポール)                             |               |        | 千シンガポールドル |         |                         |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING           |               | 180    | 60        | 4,843   | 航空宇宙・防衛                 |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD            |               | 860    | 37        | 3,030   | 食品                      |
| DBS GROUP HLDGS                      |               | 215    | 386       | 30,943  | 銀行                      |
| CITY DEVELOPMENTS LTD                |               | 40     | 33        | 2,691   | 不動産管理・開発                |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD           |               | 11     | 44        | 3,592   | 販売                      |
| SATS LTD                             |               | 80     | 39        | 3,133   | 運送インフラ                  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD               |               | 120    | 87        | 7,025   | 資本市場                    |
| CAPITALAND LIMITED                   |               | 275    | 84        | 6,783   | 不動産管理・開発                |
| GENTING SINGAPORE PLC                |               | 696    | 67        | 5,379   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| COMFORTDELGRO CORP LTD               |               | 300    | 77        | 6,198   | 陸運・鉄道                   |
| SINGAPORE AIRLINES LTD               |               | 68     | 66        | 5,337   | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED OVERSEAS BANK                 |               | 137    | 284       | 22,800  | 銀行                      |
| UOL GROUP LIMITED                    |               | 30     | 17        | 1,432   | 不動産管理・開発                |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS             |               | 170    | 63        | 5,119   | メディア                    |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED |               | 860    | 324       | 25,966  | 各種電気通信サービス              |
| SEMCORP INDUSTRIES                   |               | 120    | 35        | 2,806   | コングロマリット                |
| OCBC-ORD                             |               | 339    | 312       | 25,015  | 銀行                      |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD             |               | 170    | 62        | 4,983   | 食品                      |
| STARHUB LTD                          |               | 80     | 23        | 1,890   | 無線通信サービス                |
| KEPPEL CORP.                         |               | 150    | 88        | 7,111   | コングロマリット                |
| YANGZIJANG SHIPBUILDING              |               | 270    | 22        | 1,827   | 機械                      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L         |               | 340    | 77        | 6,208   | 不動産管理・開発                |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 5,511  | 2,298     | 184,119 |                         |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 22     | —         | <0.5%>  |                         |
| (オーストラリア)                            |               |        | 千豪ドル      |         |                         |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD               |               | 16     | 110       | 9,319   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK         |               | 329    | 926       | 78,443  | 銀行                      |
| AMCOR                                |               | 135    | 191       | 16,174  | 容器・包装                   |
| WESTPAC BANKING CORP                 |               | 378    | 1,170     | 99,120  | 銀行                      |
| BANK OF QUEENSLAND LTD               |               | 41     | 46        | 3,961   | 銀行                      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           |               | 212    | 132       | 11,236  | 金属・鉱業                   |
| TELSTRA CORP LTD                     |               | 530    | 260       | 22,033  | 各種電気通信サービス              |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD        |               | 37     | 44        | 3,793   | 銀行                      |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 |               | 87     | 81        | 6,894   | 飲料                      |
| ASX LTD                              |               | 20     | 95        | 8,069   | 資本市場                    |
| BHP BILLITON LIMITED                 |               | 361    | 908       | 76,964  | 金属・鉱業                   |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED             |               | 30     | 87        | 7,429   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD           |               | 55     | 25        | 2,195   | 複合小売り                   |
| COMPUTERSHARE LTD                    |               | 37     | 43        | 3,643   | 情報技術サービス                |
| CSL LIMITED                          |               | 50     | 478       | 40,489  | バイオテクノロジー               |
| REA GROUP LTD                        |               | 6      | 30        | 2,575   | メディア                    |
| TRANSURBAN GROUP                     |               | 217    | 215       | 18,244  | 運送インフラ                  |
| COCHLEAR LTD                         |               | 7      | 80        | 6,857   | ヘルスケア機器・用品              |
| ORIGIN ENERGY LTD                    |               | 230    | 147       | 12,502  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA       |               | 194    | 1,506     | 127,597 | 銀行                      |
| BORAL LTD                            |               | 90     | 45        | 3,810   | 建設資材                    |
| RIO TINTO LTD                        |               | 46     | 269       | 22,827  | 金属・鉱業                   |
| APA GROUP                            |               | 121    | 96        | 8,136   | ガス                      |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD               |               | 57     | 85        | 7,224   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD        |               | 300    | 166       | 14,072  | 保険                      |

| 銘柄                             |                           | 株数          | 当 期 末       |                     | 業 種 等                   |
|--------------------------------|---------------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------------|
|                                |                           |             | 評 価 額       |                     |                         |
|                                |                           |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額              |                         |
| (オーストラリア)                      |                           | 百株          | 千豪ドル        | 千円                  |                         |
| TPG TELECOM LTD                |                           | 40          | 27          | 2,313               | 各種電気通信サービス              |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD |                           | 8           | 25          | 2,156               | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ORICA LTD                      |                           | 56          | 95          | 8,117               | 化学                      |
| SUNCORP GROUP LTD              |                           | 133         | 168         | 14,245              | 保険                      |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK        |                           | 298         | 857         | 72,591              | 銀行                      |
| NEWCREST MINING                |                           | 96          | 181         | 15,346              | 金属・鉱業                   |
| OIL SEARCH LTD                 |                           | 140         | 96          | 8,202               | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INCITEC PIVOT LTD              |                           | 170         | 57          | 4,908               | 化学                      |
| AMP LIMITED                    |                           | 300         | 139         | 11,786              | 各種金融サービス                |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED         |                           | 52          | 16          | 1,403               | 旅客航空輸送業                 |
| QBE INSURANCE                  |                           | 151         | 173         | 14,702              | 保険                      |
| CHALLENGER LIMITED             |                           | 60          | 64          | 5,435               | 各種金融サービス                |
| SANTOS LTD.                    |                           | 220         | 96          | 8,196               | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SONIC HEALTHCARE LTD           |                           | 46          | 98          | 8,331               | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TABCORP HOLDINGS               |                           | 64          | 30          | 2,546               | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESFARMERS LIMITED             |                           | 125         | 504         | 42,705              | 食品・生活必需品小売り             |
| ALUMINA LTD                    |                           | 262         | 44          | 3,771               | 金属・鉱業                   |
| WOODSIDE PETROLEUM             |                           | 81          | 245         | 20,814              | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WOOLWORTHS LIMITED             |                           | 136         | 308         | 26,127              | 食品・生活必需品小売り             |
| DUET GROUP                     |                           | 240         | 65          | 5,567               | 総合公益事業                  |
| SEEK LTD                       |                           | 38          | 54          | 4,642               | 専門サービス                  |
| DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L   |                           | 5           | 32          | 2,759               | ホテル・レストラン・レジャー          |
| TATTS GROUP LTD                |                           | 149         | 61          | 5,210               | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BRAMBLES LTD                   |                           | 197         | 224         | 19,031              | 商業サービス・用品               |
| MACQUARIE GROUP LIMITED        |                           | 33          | 272         | 23,087              | 資本市場                    |
| CROWN RESORTS LTD              |                           | 48          | 56          | 4,751               | ホテル・レストラン・レジャー          |
| VOCUS COMMUNICATIONS LTD       |                           | 60          | 24          | 2,062               | 各種電気通信サービス              |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC    |                           | 49          | 103         | 8,745               | 建設資材                    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD      |                           | 100         | 104         | 8,822               | 飲料                      |
| SYDNEY AIRPORT                 |                           | 150         | 91          | 7,747               | 運送インフラ                  |
| AURIZON HOLDINGS LTD           |                           | 190         | 92          | 7,850               | 陸運・鉄道                   |
| HEALTHSCOPE LTD                |                           | 260         | 57          | 4,865               | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUSNET SERVICES                |                           | 252         | 37          | 3,144               | 電力                      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD           |                           | 300         | 80          | 6,832               | 保険                      |
| AGL ENERGY LTD                 |                           | 82          | 171         | 14,545              | 総合公益事業                  |
| SOUTH32 LTD                    |                           | 540         | 156         | 13,259              | 金属・鉱業                   |
| CIMIC GROUP LTD                |                           | 10          | 32          | 2,734               | 建設・土木                   |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 < 比 率 > | 8,729<br>62 | 12,200<br>— | 1,032,982<br><2.6%> |                         |
| (ニュージーランド)                     |                           |             | 千ニュージーランドドル |                     |                         |
| CONTACT ENERGY LTD             |                           | 100         | 46          | 3,760               | 電力                      |
| RYMAN HEALTHCARE LTD           |                           | 30          | 25          | 2,039               | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| FLETCHER BUILDING LTD          |                           | 60          | 60          | 4,936               | 建設資材                    |
| SPARK NEW ZEALAND LTD          |                           | 182         | 65          | 5,321               | 各種電気通信サービス              |
| MERCURY NZ LTD                 |                           | 86          | 25          | 2,098               | 電力                      |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD      |                           | 126         | 78          | 6,396               | 運送インフラ                  |
| MERIDIAN ENERGY LTD            |                           | 153         | 39          | 3,230               | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 < 比 率 > | 737<br>7    | 342<br>—    | 27,783<br><0.1%>    |                         |
| (イスラエル)                        |                           |             | 千新シェケル      |                     |                         |
| BANK HAPOLIM BM                |                           | 140         | 324         | 9,659               | 銀行                      |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL           |                           | 210         | 329         | 9,828               | 銀行                      |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP   |                           | 250         | 170         | 5,089               | 各種電気通信サービス              |
| ELBIT SYSTEMS LTD              |                           | 2           | 105         | 3,135               | 航空宇宙・防衛                 |

| 銘柄                       |               | 当 期 末   |        |            | 業 種 等    |
|--------------------------|---------------|---------|--------|------------|----------|
|                          |               | 株 数     | 評 価 額  |            |          |
|                          |               |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |          |
| (イスラエル)                  |               | 百株      | 千新シエケル | 千円         |          |
| FRUTAROM                 |               | 4       | 83     | 2,501      | 化学       |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED |               | 60      | 92     | 2,743      | 化学       |
| NICE LTD                 |               | 7       | 174    | 5,194      | ソフトウェア   |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD |               | 11      | 60     | 1,799      | 銀行       |
| AZRIELI GROUP            |               | 4       | 67     | 2,011      | 不動産管理・開発 |
| 小 計                      | 株 数 ・ 金 額     | 688     | 1,408  | 41,961     |          |
|                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 9       | —      | <0.1%>     |          |
| 合 計                      | 株 数 ・ 金 額     | 143,150 | —      | 37,648,883 |          |
|                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1,275   | —      | <95.3%>    |          |

\* 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。

\* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

| 銘                              | 柄             | 当 期 末   |        |         |     |
|--------------------------------|---------------|---------|--------|---------|-----|
|                                |               | 口 数     | 評 価 額  |         | 比 率 |
|                                |               |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |     |
| (アメリカ)                         |               | 口       | 千米ドル   | 千円      | %   |
| AGNC INVESTMENT CORP           |               | 3,400   | 62     | 7,059   | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT   |               | 990     | 108    | 12,376  | 0.0 |
| AMERICAN TOWER CORP            |               | 4,750   | 484    | 55,051  | 0.1 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT      |               | 11,400  | 115    | 13,116  | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC      |               | 1,490   | 245    | 27,859  | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES              |               | 1,880   | 233    | 26,503  | 0.1 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC     |               | 4,200   | 101    | 11,563  | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST          |               | 960     | 75     | 8,568   | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTL CORP         |               | 3,990   | 332    | 37,732  | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC       |               | 1,800   | 161    | 18,367  | 0.0 |
| DUKE REALTY CORP               |               | 4,300   | 110    | 12,590  | 0.0 |
| EQUINIX INC                    |               | 840     | 278    | 31,682  | 0.1 |
| EQUITY RESIDENTIAL             |               | 4,460   | 272    | 30,946  | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC       |               | 690     | 147    | 16,769  | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC        |               | 1,580   | 111    | 12,639  | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST      |               | 780     | 108    | 12,354  | 0.0 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC  |               | 6,700   | 171    | 19,473  | 0.0 |
| HCP INC                        |               | 5,400   | 157    | 17,927  | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC      |               | 7,700   | 140    | 15,978  | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC              |               | 3,200   | 108    | 12,346  | 0.0 |
| KIMCO REALTY CORP              |               | 4,900   | 125    | 14,308  | 0.0 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST         |               | 1,400   | 54     | 6,201   | 0.0 |
| MACERICH CO /THE               |               | 1,460   | 100    | 11,408  | 0.0 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM     |               | 1,300   | 115    | 13,122  | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC |               | 1,700   | 71     | 8,092   | 0.0 |
| PROLOGIS INC                   |               | 5,800   | 293    | 33,333  | 0.1 |
| PUBLIC STORAGE                 |               | 1,760   | 373    | 42,468  | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP             |               | 3,000   | 164    | 18,648  | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP           |               | 1,200   | 79     | 8,998   | 0.0 |
| SL GREEN REALTY CORP           |               | 1,290   | 139    | 15,857  | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC       |               | 3,530   | 638    | 72,473  | 0.2 |
| UDR INC                        |               | 3,200   | 107    | 12,237  | 0.0 |
| VENTAS INC                     |               | 4,070   | 243    | 27,602  | 0.1 |
| VEREIT INC                     |               | 11,100  | 91     | 10,413  | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST           |               | 2,100   | 210    | 23,935  | 0.1 |
| WELLTOWER INC                  |               | 4,320   | 270    | 30,745  | 0.1 |
| WEYERHAEUSER CO                |               | 8,900   | 282    | 32,064  | 0.1 |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST  |               | 72,000  | 30     | 3,475   | 0.0 |
| 小 計                            | 口 数 ・ 金 額     | 203,540 | 6,922  | 786,293 |     |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 38      | —      | <2.0%>  |     |
| (カナダ)                          |               |         | 千カナダドル |         |     |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS   |               | 1,200   | 26     | 2,247   | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR    |               | 1,986   | 52     | 4,486   | 0.0 |

| 銘柄                                 |         | 口数      | 当 期 末     |           |     |
|------------------------------------|---------|---------|-----------|-----------|-----|
|                                    |         |         | 評 価 額     |           | 比 率 |
|                                    |         |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |     |
| (カナダ)                              |         | 口       | 千カナダドル    | 千円        | %   |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |         | 700     | 21        | 1,859     | 0.0 |
| 小計                                 | 口数・金額   | 3,886   | 100       | 8,594     |     |
|                                    | 銘柄数<比率> | 3       | —         | <0.0%>    |     |
| (イギリス)                             |         |         | 千英ポンド     |           |     |
| BRITISH LAND                       |         | 13,600  | 79        | 11,519    | 0.0 |
| HAMMERSON PLC                      |         | 8,600   | 45        | 6,594     | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC                |         | 8,000   | 20        | 3,006     | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC          |         | 7,800   | 74        | 10,699    | 0.0 |
| SEGRO PLC                          |         | 7,800   | 32        | 4,693     | 0.0 |
| 小計                                 | 口数・金額   | 45,800  | 252       | 36,512    |     |
|                                    | 銘柄数<比率> | 5       | —         | <0.1%>    |     |
| (ユーロ…フランス)                         |         |         | 千ユーロ      |           |     |
| ICADE                              |         | 540     | 34        | 4,186     | 0.0 |
| KLEPIERRE                          |         | 2,200   | 76        | 9,327     | 0.0 |
| GECINA SA                          |         | 590     | 72        | 8,849     | 0.0 |
| FONCIERE DES REGIONS               |         | 500     | 37        | 4,517     | 0.0 |
| UNIBAIL RODAMCO-NA                 |         | 1,080   | 221       | 27,013    | 0.1 |
| ユ ー ロ 計                            | 口数・金額   | 4,910   | 441       | 53,895    |     |
|                                    | 銘柄数<比率> | 5       | —         | <0.1%>    |     |
| (香港)                               |         |         | 千香港ドル     |           |     |
| LINK REIT                          |         | 28,000  | 1,474     | 21,597    | 0.1 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS        |         | 30,000  | 202       | 2,962     | 0.0 |
| 小計                                 | 口数・金額   | 58,000  | 1,676     | 24,559    |     |
|                                    | 銘柄数<比率> | 2       | —         | <0.1%>    |     |
| (シンガポール)                           |         |         | 千シンガポールドル |           |     |
| CAPITALAND MALL TRUST              |         | 27,800  | 53        | 4,319     | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT       |         | 34,000  | 80        | 6,426     | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST        |         | 19,000  | 29        | 2,351     | 0.0 |
| SUNTEC REIT                        |         | 29,000  | 48        | 3,913     | 0.0 |
| 小計                                 | 口数・金額   | 109,800 | 212       | 17,010    |     |
|                                    | 銘柄数<比率> | 4       | —         | <0.0%>    |     |
| (オーストラリア)                          |         |         | 千豪ドル      |           |     |
| MIRVAC GROUP                       |         | 36,000  | 72        | 6,126     | 0.0 |
| GPT GROUP                          |         | 23,000  | 109       | 9,289     | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP                    |         | 6,300   | 84        | 7,163     | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP              |         | 25,800  | 109       | 9,305     | 0.0 |
| DEXUS PROPERTY GROUP               |         | 11,833  | 105       | 8,967     | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                      |         | 17,000  | 111       | 9,471     | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                      |         | 65,000  | 267       | 22,674    | 0.1 |
| WESTFIELD CORP                     |         | 24,500  | 214       | 18,151    | 0.0 |
| VICINITY CENTRES                   |         | 43,000  | 120       | 10,230    | 0.0 |
| 小計                                 | 口数・金額   | 252,433 | 1,197     | 101,380   |     |
|                                    | 銘柄数<比率> | 9       | —         | <0.3%>    |     |
| 合計                                 | 口数・金額   | 678,369 | —         | 1,028,245 |     |
|                                    | 銘柄数<比率> | 66      | —         | <2.6%>    |     |

\* 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。

\* 比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 |        |          | 当期  |     | 末   |
|-----|--------|----------|-----|-----|-----|
|     |        |          | 買建額 | 売建額 | 額   |
| 外国  | 株式先物取引 |          | 百万円 |     | 百万円 |
|     |        | CAN60    | 30  |     | —   |
|     |        | EUR050   | 111 |     | —   |
|     |        | FT100    | 68  |     | —   |
|     |        | SPI200   | 22  |     | —   |
|     |        | SPEMINI  | 625 |     | —   |
|     |        | SWISSMKT | 35  |     | —   |

\* 単位未満は切り捨て。  
\* 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。

# 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第9期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016年5月10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。  
当作成対象期間の運用状況等について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。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                                                                                                               |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAⅠ指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。MSCI-KOKUSAⅠ指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。 |
| 主な投資対象 | 外国の株式を主要投資対象とします。                                                                                                                                                                                             |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。                                                                                                                                                                |

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12- 1

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

## ○最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額   |       | ベンチマーク<br>MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・為替ヘッジあり) |       | 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 |
|----------------|--------|-------|--------------------------------------------|-------|------------|------------|----------------|-----------|
|                | 騰落     | 率     | 騰落                                         | 率     |            |            |                |           |
|                | 円      | %     |                                            | %     | %          | %          | %              | 百万円       |
| 5期(2012年5月10日) | 9,039  | △ 3.4 | 92.54                                      | △ 3.0 | 95.4       | 1.6        | 2.1            | 40,260    |
| 6期(2013年5月10日) | 11,214 | 24.1  | 114.98                                     | 24.2  | 98.8       | 1.3        | 2.4            | 46,483    |
| 7期(2014年5月12日) | 12,962 | 15.6  | 133.40                                     | 16.0  | 95.5       | 2.0        | 2.2            | 43,547    |
| 8期(2015年5月11日) | 14,736 | 13.7  | 151.85                                     | 13.8  | 94.5       | 3.2        | 2.3            | 42,676    |
| 9期(2016年5月10日) | 13,960 | △ 5.3 | 144.29                                     | △ 5.0 | 96.4       | 1.5        | 2.8            | 36,074    |

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジあり)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI円ヘッジ指数(円ベース)を使用しております。  
(出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日        | 基準価額   |        | ベンチマーク<br>MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・為替ヘッジあり) |        | 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 |
|------------|--------|--------|--------------------------------------------|--------|------------|------------|----------------|
|            | 騰落     | 率      | 騰落                                         | 率      |            |            |                |
| (期首)       | 円      | %      |                                            | %      | %          | %          | %              |
| 2015年5月11日 | 14,736 | —      | 151.85                                     | —      | 94.5       | 3.2        | 2.3            |
| 5月末        | 14,843 | 0.7    | 152.97                                     | 0.7    | 97.0       | 3.5        | 2.4            |
| 6月末        | 14,302 | △ 2.9  | 147.42                                     | △ 2.9  | 94.7       | 2.1        | 2.3            |
| 7月末        | 14,654 | △ 0.6  | 151.08                                     | △ 0.5  | 96.2       | 1.4        | 2.4            |
| 8月末        | 13,805 | △ 6.3  | 142.36                                     | △ 6.3  | 93.4       | 3.2        | 2.4            |
| 9月末        | 13,034 | △ 11.5 | 134.41                                     | △ 11.5 | 95.4       | 0.8        | 2.6            |
| 10月末       | 14,375 | △ 2.4  | 148.30                                     | △ 2.3  | 93.9       | 1.3        | 2.5            |
| 11月末       | 14,435 | △ 2.0  | 148.94                                     | △ 1.9  | 96.1       | 2.1        | 2.5            |
| 12月末       | 14,273 | △ 3.1  | 147.31                                     | △ 3.0  | 94.6       | 1.6        | 2.5            |
| 2016年1月末   | 13,044 | △ 11.5 | 134.78                                     | △ 11.2 | 96.1       | 2.6        | 2.6            |
| 2月末        | 13,304 | △ 9.7  | 137.36                                     | △ 9.5  | 88.8       | 0.6        | 2.5            |
| 3月末        | 14,001 | △ 5.0  | 144.57                                     | △ 4.8  | 96.5       | 1.1        | 2.8            |
| 4月末        | 14,267 | △ 3.2  | 147.44                                     | △ 2.9  | 93.8       | 0.7        | 2.6            |
| (期末)       |        |        |                                            |        |            |            |                |
| 2016年5月10日 | 13,960 | △ 5.3  | 144.29                                     | △ 5.0  | 96.4       | 1.5        | 2.8            |

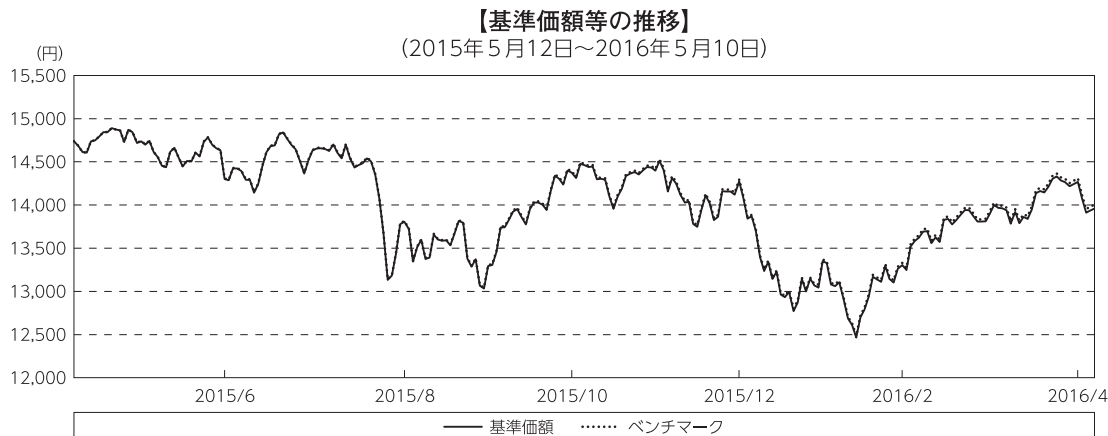
\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。  
ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。  
請求目録見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首14,736円から期末13,960円に776円の値下がりとなりました。

中国人民元の通貨切り下げをきっかけとした世界的な景気減速懸念や、原油価格の下落を受けて、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

期首より、米国の利上げに対する見方や、ギリシャの債務問題の進展状況などを巡り、欧米の株式市場は一進一退の展開となりましたが、8月に中国人民元の通貨切り下げをきっかけに世界的な景気減速懸念が高まり大幅な下落となりました。

10月になると、米企業業績が総じて市場予想を上回ったことや中国の追加金融緩和などを背景に上昇に転じましたが、12月には、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和が市場予想を下回る内容になったことや、原油など商品価格が一段と低下したことなどを受け、再び下落しました。さらに、2016年1月には、原油価格の下落が続いたことからリスク回避姿勢が強まり、世界の株式市場は大幅に下落しました。

2月中旬になると、原油価格が持ち直したことや市場予想を上回る米国経済指標の発表などを背景に上昇に転じました。その後も原油など商品価格の上昇やFOMC（米連邦公開市場委員会）声明で年内利上げペースの減速が示唆されたことなどを背景に世界の株式市場は上昇しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

株式（投資信託証券や先物を含む）組入比率は、期を通じて概ねベンチマーク（MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり））の株式比率と同等に維持しました。

### ・期中の主な動き

ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がベンチマークの中で占める比率にほぼ一致させ、ベンチマークの変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、資金流入に対しても速やかに対応しました。

### ・為替ヘッジ

為替ヘッジ（為替の売り予約）を行い、為替の送金などを含んだ外貨建て資産の実質組入比率を期を通じて概ねベンチマークの外貨比率と同等に維持しました。

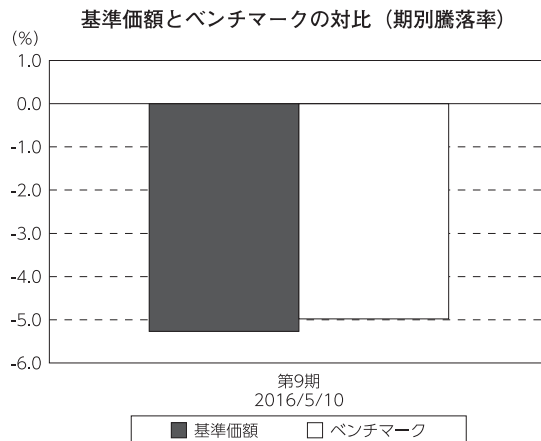
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は－5.3%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の－5.0%を0.3ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）



（注）ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                                                                                    |
|-----------------------|--------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                                                                              |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>2 | %<br>0.015 | (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>※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)    | (0.013)    |                                                                                                              |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                                                              |
| (先物・オプション)            | (0)    | (0.002)    |                                                                                                              |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2      | 0.013      | (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)                 | (2)    | (0.013)    |                                                                                                              |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                                                              |
| (c) そ の 他 費 用         | 4      | 0.027      | (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><br>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及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (3)    | (0.024)    |                                                                                                              |
| (そ の 他)               | (0)    | (0.004)    |                                                                                                              |
| 合 計                   | 8      | 0.055      |                                                                                                              |
| 期中の平均基準価額は、14,028円です。 |        |            |                                                                                                              |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

## 株式

|     |         | 買 付                     |                              | 売 付                   |                            |
|-----|---------|-------------------------|------------------------------|-----------------------|----------------------------|
|     |         | 株 数                     | 金 額                          | 株 数                   | 金 額                        |
| 外 国 | アメリカ    | 百株<br>7,901<br>( 1,433) | 千米ドル<br>46,671<br>( 2,586)   | 百株<br>6,852<br>( 885) | 千米ドル<br>39,371<br>( 5,108) |
|     | カナダ     | 864<br>(△ 3)            | 千カナダドル<br>3,666<br>( ー)      | 717<br>( 123)         | 千カナダドル<br>2,718<br>( 253)  |
|     | イギリス    | 7,716<br>( 33,832)      | 千英ポンド<br>4,342<br>( 347)     | 5,668<br>(48,362)     | 千英ポンド<br>3,132<br>( 536)   |
|     | スイス     | 469<br>( 174)           | 千スイスフラン<br>2,867<br>( 10)    | 527<br>( 2)           | 千スイスフラン<br>2,195<br>( 95)  |
|     | スウェーデン  | 494<br>( 296)           | 千スウェーデンクローナ<br>6,446<br>( ー) | 514                   | 千スウェーデンクローナ<br>5,716       |
|     | ノルウェー   | 143                     | 千ノルウェークローネ<br>2,020          | 184                   | 千ノルウェークローネ<br>1,754        |
|     | デンマーク   | 113<br>( 8)             | 千デンマーククローネ<br>4,650<br>( ー)  | 72                    | 千デンマーククローネ<br>3,014        |
|     | ユーロ     |                         | 千ユーロ                         |                       | 千ユーロ                       |
|     | ドイツ     | 502<br>( 72)            | 2,337<br>( 6)                | 370<br>( ー)           | 1,830<br>( 41)             |
|     | イタリア    | 2,207<br>( 596)         | 668<br>( 149)                | 1,689<br>( 500)       | 545<br>( 125)              |
|     | フランス    | 584<br>(△ 288)          | 2,584<br>(△ 99)              | 449<br>( ー)           | 2,077<br>( 7)              |
|     | オランダ    | 324<br>( 255)           | 725<br>( 143)                | 252<br>( 105)         | 581<br>( 42)               |
|     | スペイン    | 1,205<br>( 537)         | 848<br>( 104)                | 935<br>( 605)         | 694<br>( 105)              |
|     | ベルギー    | 54<br>( 5)              | 349<br>( 4)                  | 53<br>( ー)            | 282<br>( 4)                |
|     | オーストリア  | 28                      | 65                           | 117                   | 97                         |
|     | ルクセンブルグ | ー                       | ー                            | ー<br>( 9)             | ー<br>( 83)                 |
|     | フィンランド  | 213<br>( 158)           | 232<br>( 99)                 | 123                   | 158                        |
|     | アイルランド  | 35                      | 220                          | 21                    | 71                         |
|     | ポルトガル   | 34                      | 40                           | 45                    | 15                         |

|     |          | 買 付                   |                            | 売 付                 |                            |
|-----|----------|-----------------------|----------------------------|---------------------|----------------------------|
|     |          | 株 数                   | 金 額                        | 株 数                 | 金 額                        |
| 外 国 | 香港       | 百株<br>1,730<br>( 565) | 千香港ドル<br>6,054<br>( 3,704) | 百株<br>808<br>( 240) | 千香港ドル<br>5,049<br>( 3,704) |
|     | シンガポール   | 837<br>( 2)           | 千シンガポールドル<br>478<br>( 5)   | 610<br>( 1)         | 千シンガポールドル<br>365<br>( 2)   |
|     | オーストラリア  | 2,107<br>( 859)       | 千豪ドル<br>2,640<br>( 174)    | 1,389<br>( 79)      | 千豪ドル<br>1,710<br>( 118)    |
|     | ニュージーランド | 60                    | 千ニュージーランドドル<br>31          | —                   | 千ニュージーランドドル<br>—           |
|     | イスラエル    | 66                    | 千新シェケル<br>558              | 10                  | 千新シェケル<br>266              |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 投資信託証券

| 銘 柄 | 買 付                                |                       | 売 付              |               |
|-----|------------------------------------|-----------------------|------------------|---------------|
|     | 口 数                                | 金 額                   | 口 数              | 金 額           |
| 外 国 | アメリカ                               | 口 千米ドル                | 口 千米ドル           |               |
|     | AMERICAN REALTY CAPITAL PROP       | —                     | —<br>(11, 100)   | —<br>( 100)   |
|     | AMERICAN TOWER CORP                | 630                   | 300              | 29            |
|     | AVALONBAY COMMUNITIES INC          | 170                   | —                | —             |
|     | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC         | 1, 900                | —                | —             |
|     | CARE CAPITAL PROPERTIES INC        | —                     | 872              | 28            |
|     |                                    | ( 872)                |                  |               |
|     | COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC | —                     | 1, 460           | 27            |
|     | DIGITAL REALTY TRUST INC           | 460                   | —                | —             |
|     | DUKE REALTY CORP                   | 1, 300                | 1, 400           | 29            |
|     | EQUINIX INC                        | 282                   | 100              | 29            |
|     |                                    | ( 18)                 |                  |               |
|     | EQUITY RESIDENTIAL                 | 790                   | 400              | 32            |
|     | EXTRA SPACE STORAGE INC            | 1, 170                | —                | —             |
|     | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST        | —                     | 466              | 9             |
|     |                                    | ( 466)                |                  |               |
|     | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC      | 2, 100                | 1, 100           | 31            |
|     | HCP INC                            | 1, 600                | 1, 500           | 57            |
|     | HEALTH CARE REIT INC               | —                     | —                | —             |
|     |                                    | (△ 3, 890)            |                  |               |
|     | IRON MOUNTAIN INC                  | 1, 690                | —                | —             |
|     | KIMCO REALTY CORP                  | 1, 100                | 1, 200           | 31            |
|     | MID-AMERICA APARTMENT COMM         | 820                   | —                | —             |
|     | PLUM CREEK TIMBER CO               | —                     | —                | —             |
|     |                                    |                       | ( 2, 000)        | ( 85)         |
|     | PUBLIC STORAGE                     | 270                   | 140              | 38            |
|     | RAYONIER INC                       | —                     | 1, 000           | 25            |
|     | REALTY INCOME CORP                 | 500                   | —                | —             |
|     | REGENCY CENTERS CORP               | 400                   | 450              | 30            |
|     | SL GREEN REALTY CORP               | 540                   | 260              | 30            |
|     | SIMON PROPERTY GROUP INC           | 990                   | 830              | 162           |
|     | UDR INC                            | 1, 500                | 800              | 29            |
|     | VENTAS INC                         | 1, 010                | 500              | 31            |
|     | VEREIT INC                         | —                     | —                | —             |
|     |                                    | ( 11, 100)            |                  |               |
|     | VORNADO REALTY TRUST               | 1, 000                | 900              | 88            |
|     | WELLTOWER INC                      | —                     | —                | —             |
|     |                                    | ( 3, 890)             |                  |               |
|     | WEYERHAEUSER CO                    | —                     | —                | —             |
|     |                                    | ( 3, 200)             |                  |               |
|     | 小 計                                | 20, 222<br>( 15, 656) | 1, 277<br>( 202) | 745<br>( 186) |

|     | 銘 柄                                | 買 付                 |                 | 売 付                |                 |
|-----|------------------------------------|---------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
|     |                                    | 口 数                 | 金 額             | 口 数                | 金 額             |
| 外 国 | カナダ                                | 口                   | 千カナダドル          | 口                  | 千カナダドル          |
|     | SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 700                 | 22              | —                  | —               |
|     | 小 計                                | 700                 | 22              | —                  | —               |
|     | イギリス                               |                     | 千英ポンド           |                    | 千英ポンド           |
|     | INTU PROPERTIES PLC                | 7,000               | 20              | 11,480             | 36              |
|     | 小 計                                | 7,000               | 20              | 11,480             | 36              |
|     | ユーロ                                |                     | 千ユーロ            |                    | 千ユーロ            |
|     | フランス                               |                     |                 |                    |                 |
|     | KLEPIERRE                          | 612                 | 24              | —                  | —               |
|     | UNIBAIL RODAMCO-NA                 | 360                 | 83              | 310                | 73              |
|     | 小 計                                | 972                 | 107             | 310                | 73              |
|     | ユ ー ロ 計                            | 972                 | 107             | 310                | 73              |
|     | 香港                                 |                     | 千香港ドル           |                    | 千香港ドル           |
|     | LINK REIT                          | 10,000              | 451             | 8,000              | 370             |
|     | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS        | 30,000              | 180             | —                  | —               |
|     | 小 計                                | 40,000              | 631             | 8,000              | 370             |
|     | シンガポール                             |                     | 千シンガポールドル       |                    | 千シンガポールドル       |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT       | —<br>( —)           | —<br>( 0.04593) | —<br>( —)          | —<br>( 0.056)   |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV-RTS       | —<br>( 712)         | —<br>( 0.04593) | —<br>( 712)        | —<br>(0.04593)  |
|     | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST        | —                   | —               | 11,000             | 17              |
|     | SUNTEC REIT                        | —                   | —               | —<br>( —)          | —<br>(0.26419)  |
|     | 小 計                                | —<br>( 712)         | —<br>( 0.09186) | 11,000<br>( 712)   | 17<br>(0.36612) |
|     | オーストラリア                            |                     | 千豪ドル            |                    | 千豪ドル            |
|     | GPT GROUP                          | 16,400              | 76              | 9,000              | 42              |
|     | FEDERATION CENTRES                 | —<br>( 23,276)      | —<br>( 71)      | 9,000<br>(32,776)  | 25<br>( 98)     |
|     | NOVION PROPERTY GROUP              | —                   | —               | —<br>(28,300)      | —<br>( 71)      |
|     | VICINITY CENTRES                   | 22,224<br>( 32,776) | 72<br>( 98)     | 12,000             | 38              |
|     | 小 計                                | 38,624<br>( 56,052) | 148<br>( 169)   | 30,000<br>(61,076) | 106<br>( 169)   |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

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>11,971 | 百万円<br>12,736 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2015年5月12日～2016年5月10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       | 15,545,362千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 36,910,859千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.42         |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等           |                    |               | 売付額等           |                    |               |
|--------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|        | A              | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C              | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替先物取引 | 百万円<br>583,136 | 百万円<br>1,293       | %<br>0.2      | 百万円<br>581,200 | 百万円<br>3,362       | %<br>0.6      |
| 為替直物取引 | 6,750          | 3,385              | 50.1          | 6,690          | 1,313              | 19.6          |
| 預金     | 12,362         | 12,362             | 100.0         | 12,362         | 12,362             | 100.0         |

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年5月10日現在)

## 外国株式

| 銘<br>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    | 千米ドル  | 千円      |                         |
| ADT CORP/THE                | 16      | —     | —     | —       | 商業サービス・用品               |
| AFLAC INC                   | 50      | 50    | 345   | 37,446  | 保険                      |
| AGCO CORP                   | 7       | 7     | 39    | 4,264   | 機械                      |
| AGL RESOURCES INC           | —       | 13    | 86    | 9,332   | ガス                      |
| AES CORP                    | 66      | 66    | 73    | 7,988   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AT & T INC                  | 562     | 701   | 2,724 | 295,454 | 各種電気通信サービス              |
| ABBOTT LABORATORIES         | 167     | 168   | 638   | 69,204  | ヘルスケア機器・用品              |
| ABBVIE INC                  | 172     | 188   | 1,197 | 129,887 | バイオテクノロジー               |
| ACTIVISION BLIZZARD INC     | 52      | 62    | 230   | 24,981  | ソフトウェア                  |
| ACUITY BRANDS INC           | —       | 4     | 114   | 12,413  | 電気設備                    |
| ADOBE SYSTEMS INC.          | 53      | 58    | 548   | 59,516  | ソフトウェア                  |
| ADVANCE AUTO PARTS          | 7       | 7     | 115   | 12,490  | 専門小売り                   |
| AETNA INC                   | 38      | 39    | 444   | 48,191  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP   | 6       | 6     | 98    | 10,714  | 資本市場                    |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC    | 34      | 34    | 142   | 15,465  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AIR PRODUCTS                | 24      | 23    | 335   | 36,348  | 化学                      |
| AIRGAS INC                  | 6       | 6     | 92    | 10,053  | 化学                      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES         | 18      | 18    | 92    | 10,008  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ALBEMARLE CORP              | 10      | 10    | 71    | 7,807   | 化学                      |
| ALCOA INC                   | 135     | 135   | 127   | 13,851  | 金属・鉱業                   |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 21      | 24    | 354   | 38,448  | バイオテクノロジー               |
| ALLEGHANY CORP              | 1       | 1     | 88    | 9,569   | 保険                      |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP  | 6       | 6     | 138   | 14,993  | 情報技術サービス                |
| ALLIANT ENERGY CORP         | 10      | 14    | 107   | 11,629  | 総合公益事業                  |
| ALLSTATE CORP               | 44      | 42    | 282   | 30,616  | 保険                      |
| ALLY FINANCIAL INC          | 44      | 44    | 74    | 8,112   | 消費者金融                   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | —       | 8     | 46    | 5,016   | バイオテクノロジー               |
| ALPHABET INC-CL C           | —       | 35    | 2,528 | 274,258 | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ALPHABET INC-CL A           | —       | 33    | 2,423 | 262,866 | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ALTERA CORP.                | 32      | —     | —     | —       | 半導体・半導体製造装置             |
| ALTRIA GROUP INC            | 213     | 225   | 1,432 | 155,352 | タバコ                     |
| AMAZON.COM INC              | 43      | 45    | 3,086 | 334,788 | インターネット販売・カタログ販売        |
| AMERCO                      | —       | 0.8   | 28    | 3,129   | 陸運・鉄道                   |
| AMEREN CORPORATION          | 30      | 29    | 140   | 15,232  | 総合公益事業                  |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 18      | 18    | 59    | 6,466   | 旅客航空輸送業                 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER     | 54      | 54    | 352   | 38,239  | 電力                      |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 103     | 97    | 620   | 67,310  | 消費者金融                   |
| AMERICAN INTL GROUP         | 155     | 143   | 790   | 85,691  | 保険                      |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 22      | 21    | 156   | 16,920  | 水道                      |
| AMERISOURCEBERGEN CORP      | 23      | 20    | 160   | 17,454  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC    | 19      | 19    | 184   | 20,057  | 資本市場                    |
| AMETEK INC                  | 26      | 26    | 120   | 13,059  | 電気設備                    |
| AMGEN INC                   | 82      | 86    | 1,342 | 145,633 | バイオテクノロジー               |

| 銘柄                          | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等                   |
|-----------------------------|-------|---------|-------|---------|-------------------------|
|                             |       | 株数      | 評 価 額 |         |                         |
|                             |       |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                      | 百株    | 百株      | 千米ドル  | 千円      |                         |
| AMPHENOL CORP-CL A          | 36    | 36      | 202   | 21,931  | 電子装置・機器・部品              |
| ANADARKO PETE               | 55    | 58      | 260   | 28,301  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ANALOG DEVICES INC          | 36    | 38      | 209   | 22,762  | 半導体・半導体製造装置             |
| ANSYS INC                   | 9     | 9       | 80    | 8,737   | ソフトウェア                  |
| ANTERO RESOURCES CORP       | 7     | 7       | 18    | 1,990   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ANTHEM INC                  | 29    | 29      | 412   | 44,745  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APACHE CORPORATION          | 42    | 45      | 234   | 25,438  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| APPLE INC                   | 638   | 634     | 5,882 | 638,057 | コンピュータ・周辺機器             |
| APPLIED MATERIALS           | 136   | 134     | 266   | 28,907  | 半導体・半導体製造装置             |
| ARAMARK                     | —     | 30      | 102   | 11,072  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARCHER DANIELS MIDLAND      | 72    | 64      | 241   | 26,190  | 食品                      |
| ARROW ELECTRS INC           | 11    | 11      | 70    | 7,639   | 電子装置・機器・部品              |
| ASHLAND INC                 | 7     | 7       | 86    | 9,358   | 化学                      |
| ASSURANT INC                | 9     | 6       | 59    | 6,441   | 保険                      |
| ATMOS ENERGY CORP           | —     | 11      | 81    | 8,864   | ガス                      |
| AUTODESK INC.               | 26    | 23      | 135   | 14,665  | ソフトウェア                  |
| AUTOLIV INC                 | 10    | 10      | 124   | 13,516  | 自動車部品                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESS      | 52    | 52      | 453   | 49,157  | 情報技術サービス                |
| AUTONATION INC              | 6     | 6       | 31    | 3,408   | 専門小売り                   |
| AUTOZONE                    | 3     | 3       | 284   | 30,855  | 専門小売り                   |
| AVERY DENNISON CORP         | 12    | 12      | 91    | 9,949   | 容器・包装                   |
| AVNET                       | 16    | 16      | 62    | 6,774   | 電子装置・機器・部品              |
| AVON PRODUCTS INC           | 48    | —       | —     | —       | パーソナル用品                 |
| BB&T CORPORATION            | 79    | 88      | 296   | 32,193  | 銀行                      |
| BAKER HUGHES                | 48    | 51      | 225   | 24,476  | エネルギー設備・サービス            |
| BALL CORP                   | 12    | 13      | 93    | 10,154  | 容器・包装                   |
| BANK OF AMERICA CORP        | 1,155 | 1,191   | 1,666 | 180,717 | 銀行                      |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 122   | 124     | 488   | 52,948  | 資本市場                    |
| BARD (C R)                  | 8     | 8       | 189   | 20,545  | ヘルスケア機器・用品              |
| BAXALTA INC                 | —     | 80      | 338   | 36,746  | バイオテクノロジー               |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.   | 57    | 65      | 293   | 31,830  | ヘルスケア機器・用品              |
| B/E AEROSPACE INC           | 10    | 10      | 49    | 5,328   | 航空宇宙・防衛                 |
| BECTON, DICKINSON           | 23    | 23      | 383   | 41,585  | ヘルスケア機器・用品              |
| BED BATH & BEYOND           | 19    | 19      | 86    | 9,435   | 専門小売り                   |
| WR BERKLEY CORP             | 9     | 9       | 54    | 5,914   | 保険                      |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 126   | 135     | 1,936 | 210,025 | 各種金融サービス                |
| BEST BUY COMPANY INC        | 33    | 33      | 107   | 11,689  | 専門小売り                   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 16    | 19      | 165   | 17,943  | バイオテクノロジー               |
| BIOGEN INC                  | 25    | 25      | 678   | 73,549  | バイオテクノロジー               |
| BLACKROCK INC               | 14    | 14      | 497   | 53,906  | 資本市場                    |
| H & R BLOCK INC             | 34    | 31      | 61    | 6,674   | 各種消費者サービス               |
| BOEING CO                   | 73    | 73      | 966   | 104,877 | 航空宇宙・防衛                 |
| BORGWARNER INC              | 25    | 25      | 85    | 9,285   | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 153   | 153     | 338   | 36,739  | ヘルスケア機器・用品              |
| BRISTOL MYERS SQUIBB        | 179   | 191     | 1,363 | 147,864 | 医薬品                     |
| BROADCOM CORP-CL A          | 58    | —       | —     | —       | 半導体・半導体製造装置             |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B      | 12    | 12      | 121   | 13,186  | 飲料                      |
| CBS CORP-CL B               | 52    | 47      | 263   | 28,546  | メディア                    |

| 銘柄                           | 株数  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等                   |        |
|------------------------------|-----|---------|-------|---------|-------------------------|--------|
|                              |     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |                         |        |
|                              |     |         |       | 外貨建金額   |                         | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ)                       | 百株  | 百株      | 千米ドル  | 千円      |                         |        |
| CBRE GROUP INC               | 36  | 29      | 84    | 9,130   | 不動産管理・開発                |        |
| CDK GLOBAL INC               | —   | 14      | 73    | 7,999   | ソフトウェア                  |        |
| CDW CORPORATION              | —   | 15      | 61    | 6,639   | 電子装置・機器・部品              |        |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 5   | 24      | 72    | 7,915   | 化学                      |        |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 16  | 16      | 118   | 12,851  | 航空貨物・物流サービス             |        |
| CIGNA CORP                   | 28  | 28      | 370   | 40,183  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| CIT GROUP INC                | 19  | 19      | 61    | 6,633   | 銀行                      |        |
| CME GROUP INC                | 34  | 37      | 356   | 38,639  | 各種金融サービス                |        |
| CMS ENERGY CORP              | 28  | 28      | 115   | 12,569  | 総合公益事業                  |        |
| CSX CORP                     | 106 | 106     | 274   | 29,719  | 陸運・鉄道                   |        |
| CVS HEALTH CORP              | 123 | 126     | 1,341 | 145,536 | 食品・生活必需品小売り             |        |
| CA INC                       | 39  | 39      | 116   | 12,609  | ソフトウェア                  |        |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 23  | 23      | 79    | 8,631   | メディア                    |        |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 47  | 47      | 114   | 12,421  | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CALPINE CORP                 | 39  | 39      | 58    | 6,306   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |        |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP   | 21  | —       | —     | —       | エネルギー設備・サービス            |        |
| CAMPBELL SOUP CO             | 21  | 21      | 136   | 14,791  | 食品                      |        |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 60  | 59      | 410   | 44,538  | 消費者金融                   |        |
| CARDINAL HEALTH INC          | 37  | 36      | 282   | 30,639  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| CARMAX INC                   | 22  | 22      | 115   | 12,557  | 専門小売り                   |        |
| CARNIVAL CORP                | 42  | 48      | 238   | 25,895  | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| CATERPILLAR INC DEL          | 63  | 67      | 480   | 52,125  | 機械                      |        |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 15  | 15      | 110   | 11,956  | 化学                      |        |
| CELGENE CORP                 | 86  | 90      | 925   | 100,410 | バイオテクノロジー               |        |
| CENTENE CORP                 | —   | 21      | 127   | 13,816  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 51  | 51      | 110   | 11,992  | 総合公益事業                  |        |
| CENTURYLINK INC              | 63  | 63      | 177   | 19,275  | 各種電気通信サービス              |        |
| CERNER CORP                  | 33  | 33      | 186   | 20,260  | ヘルスケア・テクノロジー            |        |
| CHARTER COMMUNICATION-A      | 8   | 9       | 209   | 22,690  | メディア                    |        |
| CHENIERE ENERGY INC          | 24  | 24      | 78    | 8,473   | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 51  | —       | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CHEVRON CORP                 | 205 | 214     | 2,156 | 233,896 | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR | 9   | 9       | 34    | 3,732   | 建設・土木                   |        |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 3   | 3       | 154   | 16,711  | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| CHUBB CORP                   | 26  | —       | —     | —       | 保険                      |        |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 13  | 13      | 132   | 14,425  | 家庭用品                    |        |
| CIMAREX ENERGY CO            | 8   | 11      | 131   | 14,256  | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 15  | 19      | 131   | 14,298  | 保険                      |        |
| CISCO SYSTEMS                | 554 | 581     | 1,540 | 167,053 | 通信機器                    |        |
| CINTAS CORP                  | 12  | 9       | 82    | 8,927   | 商業サービス・用品               |        |
| CITIGROUP                    | 332 | 341     | 1,496 | 162,326 | 銀行                      |        |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | —   | 66      | 144   | 15,641  | 銀行                      |        |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 17  | 17      | 139   | 15,098  | ソフトウェア                  |        |
| CLOROX CO                    | 13  | 15      | 206   | 22,422  | 家庭用品                    |        |
| COACH INC                    | 32  | 32      | 131   | 14,298  | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| COBALT INTERNATIONAL ENERGY  | 42  | —       | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| COCA COLA CO                 | 433 | 472     | 2,135 | 231,597 | 飲料                      |        |
| COCA COLA ENTERPRISES        | 24  | 24      | 128   | 13,952  | 飲料                      |        |

| 銘柄                             | 株数  | 期首(前期末) | 当期    |         | 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      | 千米ドル  | 千円      |                         |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP  | 68  | 69      | 419   | 45,516  | 情報技術サービス                |
| COLGATE PALMOLIVE CO.          | 100 | 96      | 688   | 74,717  | 家庭用品                    |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP        | —   | 48      | 122   | 13,337  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMCAST CORP-CL A              | 232 | 284     | 1,744 | 189,189 | メディア                    |
| COMCAST CORP SPECIAL CL-A      | 44  | —       | —     | —       | メディア                    |
| COMERICA INC                   | 18  | 18      | 75    | 8,236   | 銀行                      |
| COMPUTER SCIENCE               | 14  | —       | —     | —       | 情報技術サービス                |
| CONAGRA INC                    | 48  | 48      | 219   | 23,781  | 食品                      |
| CONCHO RESOURCES INC           | 13  | 15      | 179   | 19,455  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONOCOPHILLIPS                 | 132 | 137     | 570   | 61,887  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONSOL ENERGY INC              | 27  | —       | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONSOLIDATED EDISON INC        | 33  | 33      | 245   | 26,611  | 総合公益事業                  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A     | 17  | 19      | 312   | 33,899  | 飲料                      |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK   | 11  | 11      | 45    | 4,958   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| THE COOPER COMPANIES, INC.     | 5   | 5       | 91    | 9,926   | ヘルスケア機器・用品              |
| CORNING INC                    | 144 | 128     | 234   | 25,461  | 電子装置・機器・部品              |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION   | 48  | 49      | 731   | 79,291  | 食品・生活必需品小売り             |
| CREE INC                       | 16  | —       | —     | —       | 半導体・半導体製造装置             |
| CROWN HOLDINGS INC             | 17  | 17      | 91    | 9,886   | 容器・包装                   |
| CUMMINS INC                    | 19  | 19      | 223   | 24,264  | 機械                      |
| DR HORTON INC                  | 41  | 42      | 124   | 13,483  | 家庭用耐久財                  |
| DTE ENERGY COMPANY             | 18  | 18      | 168   | 18,224  | 総合公益事業                  |
| DANAHER CORP                   | 68  | 71      | 693   | 75,163  | コングロマリット                |
| DARDEN RESTAURANTS INC         | 15  | 14      | 90    | 9,786   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 19  | 19      | 146   | 15,917  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY                | 36  | 36      | 290   | 31,462  | 機械                      |
| DELTA AIR LINES INC            | 25  | 24      | 101   | 11,036  | 旅客航空輸送業                 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC     | 13  | —       | —     | —       | ヘルスケア機器・用品              |
| DENTSPLY SIRONA INC            | —   | 29      | 175   | 19,035  | ヘルスケア機器・用品              |
| DEVON ENERGY CORP              | 40  | 56      | 168   | 18,245  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DIAMOND OFFSHORE DRILLING      | 6   | —       | —     | —       | エネルギー設備・サービス            |
| DICK S SPORTING GOODS INC      | 13  | 13      | 59    | 6,413   | 専門小売り                   |
| DISNEY (WALT) CO               | 174 | 179     | 1,890 | 205,081 | メディア                    |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES    | 51  | 51      | 281   | 30,511  | 消費者金融                   |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC   | 20  | 20      | 57    | 6,197   | メディア                    |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C     | 33  | 33      | 92    | 10,017  | メディア                    |
| DISH NETWORK CORP-A            | 24  | 24      | 118   | 12,822  | メディア                    |
| DIRECTV                        | 50  | —       | —     | —       | メディア                    |
| DOLLAR GENERAL CORP            | 33  | 33      | 280   | 30,451  | 複合小売り                   |
| DOLLAR TREE INC                | 21  | 23      | 195   | 21,248  | 複合小売り                   |
| DOMINION RESOURCES INC/VA      | 64  | 69      | 496   | 53,803  | 総合公益事業                  |
| DOVER CORP                     | 17  | 17      | 111   | 12,115  | 機械                      |
| DOW CHEM CO                    | 130 | 127     | 645   | 70,029  | 化学                      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC    | 22  | 22      | 208   | 22,641  | 飲料                      |
| DU PONT E I DE NEMOURS         | 100 | 102     | 653   | 70,902  | 化学                      |
| DUKE ENERGY CORP               | 76  | 79      | 638   | 69,205  | 電力                      |
| DUN & BRADSTREET CORP          | 3   | 3       | 37    | 4,121   | 専門サービス                  |
| EMC CORP                       | 223 | 219     | 588   | 63,799  | コンピュータ・周辺機器             |

| 銘柄                                 | 株数  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等                   |
|------------------------------------|-----|---------|-------|---------|-------------------------|
|                                    |     | 株数      | 評 価 額 |         |                         |
|                                    |     |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                             | 百株  | 百株      | 千米ドル  | 千円      |                         |
| EOG RESOURCES INC                  | 59  | 64      | 503   | 54,587  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| EQT CORP                           | 16  | 21      | 148   | 16,099  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| E*TRADE FINANCIAL CORP             | —   | 31      | 77    | 8,375   | 資本市場                    |
| EASTMAN CHEMICAL CO.               | 15  | 15      | 114   | 12,407  | 化学                      |
| EATON VANCE CORP                   | 15  | 15      | 51    | 5,562   | 資本市場                    |
| EBAY INC                           | 122 | 121     | 290   | 31,523  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| ECOLAB INC                         | 30  | 30      | 352   | 38,197  | 化学                      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO          | —   | 6       | 48    | 5,272   | パーソナル用品                 |
| EDISON INTERNATIONAL               | 34  | 37      | 268   | 29,130  | 電力                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP          | 11  | 25      | 273   | 29,652  | ヘルスケア機器・用品              |
| ELECTRONIC ARTS                    | 33  | 33      | 212   | 23,092  | ソフトウェア                  |
| EMERSON ELEC                       | 74  | 75      | 394   | 42,803  | 電気設備                    |
| ENERGEN CORP                       | 9   | —       | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ENERGIZER HOLDINGS INC             | 6   | —       | —     | —       | 家庭用品                    |
| ENTERGY CORP                       | 18  | 18      | 143   | 15,606  | 電力                      |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS       | —   | 19      | 44    | 4,859   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EQUIFAX INC                        | 12  | 12      | 148   | 16,138  | 専門サービス                  |
| EVERSOURCE ENERGY                  | 33  | 33      | 192   | 20,921  | 電力                      |
| EXELON CORPORATION                 | 95  | 106     | 373   | 40,526  | 電力                      |
| EXPEDIA INC                        | 11  | 14      | 158   | 17,219  | インターネット販売・カタログ販売        |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC  | 22  | 22      | 106   | 11,524  | 航空貨物・物流サービス             |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON | 81  | 78      | 579   | 62,808  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EXXON MOBIL CORP                   | 460 | 473     | 4,197 | 455,242 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FLIR SYSTEMS INC                   | 12  | 12      | 36    | 3,978   | 電子装置・機器・部品              |
| FMC CORP                           | 16  | 16      | 78    | 8,491   | 化学                      |
| FMC TECHNOLOGIES INC               | 26  | 26      | 71    | 7,807   | エネルギー設備・サービス            |
| FACEBOOK INC-A                     | 219 | 258     | 3,084 | 334,570 | インターネットソフトウェア・サービス      |
| FAMILY DOLLAR STORES               | 12  | —       | —     | —       | 複合小売り                   |
| FASTENAL CO                        | 29  | 29      | 134   | 14,619  | 商社・流通業                  |
| FEDEX CORPORATION                  | 29  | 31      | 507   | 55,094  | 航空貨物・物流サービス             |
| F5 NETWORKS INC                    | 7   | 7       | 75    | 8,175   | 通信機器                    |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION      | 32  | 33      | 243   | 26,369  | 情報技術サービス                |
| FNF GROUP                          | 25  | 25      | 84    | 9,151   | 保険                      |
| FIFTH THIRD BANCORP                | 86  | 86      | 149   | 16,164  | 銀行                      |
| FIREEYE INC                        | 9   | —       | —     | —       | ソフトウェア                  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 14  | 18      | 125   | 13,614  | 銀行                      |
| FISERV INC                         | 25  | 25      | 262   | 28,433  | 情報技術サービス                |
| FIRSTENERGY CORP                   | 44  | 44      | 147   | 16,010  | 電力                      |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 8   | 8       | 127   | 13,842  | 情報技術サービス                |
| FLUOR CORP                         | 19  | 14      | 71    | 7,771   | 建設・土木                   |
| FLOWERVE CORP                      | 14  | 14      | 66    | 7,265   | 機械                      |
| FOOT LOCKER INC                    | 17  | 17      | 105   | 11,461  | 専門小売り                   |
| FORD MOTOR COMPANY                 | 396 | 430     | 572   | 62,121  | 自動車                     |
| FORTINET INC                       | —   | 15      | 48    | 5,215   | ソフトウェア                  |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | —   | 17      | 96    | 10,461  | 建設関連製品                  |
| FOSSIL GROUP INC                   | 4   | —       | —     | —       | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FRANKLIN RESOURCES INC             | 43  | 43      | 156   | 16,922  | 資本市場                    |
| FREEPORT-MCMORAN INC               | 112 | 116     | 122   | 13,235  | 金属・鉱業                   |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |         | 業 種 等                   |
|------------------------------|---------|-------|-------|---------|-------------------------|
|                              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                         |
|                              |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CO   | 113     | 113   | 59    | 6,434   | 各種電気通信サービス              |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | —       | 17    | 79    | 8,649   | 保険                      |
| GAMESTOP CORP-CLASS A        | 14      | 14    | 42    | 4,584   | 専門小売り                   |
| GAP INC                      | 24      | 24    | 52    | 5,677   | 専門小売り                   |
| GARTNER INC                  | —       | 9     | 88    | 9,570   | 情報技術サービス                |
| GENERAL DYNAMICS             | 30      | 30    | 428   | 46,519  | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL ELEC CO              | 1,091   | 1,075 | 3,211 | 348,267 | コングロマリット                |
| GENERAL MILLS                | 65      | 66    | 414   | 44,904  | 食品                      |
| GENERAL MOTORS CO            | 137     | 161   | 495   | 53,748  | 自動車                     |
| GENUINE PARTS CO             | 16      | 16    | 155   | 16,834  | 販売                      |
| GENWORTH FINANCIAL INC-CL A  | 69      | —     | —     | —       | 保険                      |
| GILEAD SCIENCES INC          | 163     | 165   | 1,414 | 153,407 | バイオテクノロジー               |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | —       | 19    | 141   | 15,368  | 情報技術サービス                |
| GOLDMAN SACHS GROUP          | 43      | 44    | 699   | 75,850  | 資本市場                    |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    | —       | 28    | 78    | 8,557   | 自動車部品                   |
| GOOGLE INC-CL A              | 31      | —     | —     | —       | インターネットソフトウェア・サービス      |
| GOOGLE INC-CL C              | 31      | —     | —     | —       | インターネットソフトウェア・サービス      |
| WR GRACE & CO                | —       | 8     | 60    | 6,577   | 化学                      |
| GRAINGER(W.W.) INC           | 7       | 6     | 140   | 15,255  | 商社・流通業                  |
| HCA HOLDINGS INC             | 32      | 35    | 287   | 31,179  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HP INC                       | —       | 189   | 216   | 23,430  | コンピュータ・周辺機器             |
| HALLIBURTON CO               | 93      | 94    | 363   | 39,445  | エネルギー設備・サービス            |
| HANESBRANDS INC              | 40      | 49    | 136   | 14,763  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| HARLEY-DAVIDSON INC          | 25      | 19    | 87    | 9,458   | 自動車                     |
| HARMAN INTERNATIONAL         | —       | 7     | 52    | 5,724   | 家庭用耐久財                  |
| HARRIS CORP                  | 10      | 13    | 98    | 10,669  | 通信機器                    |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES  | 48      | 48    | 212   | 22,995  | 保険                      |
| HASBRO INC                   | 11      | 11    | 94    | 10,273  | レジャー用品                  |
| HELMERICH & PAYNE            | 10      | 10    | 61    | 6,635   | エネルギー設備・サービス            |
| HERSHEY CO/THE               | 16      | 16    | 148   | 16,147  | 食品                      |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC    | 46      | 46    | 40    | 4,370   | 陸運・鉄道                   |
| HESS CORP                    | 28      | 28    | 156   | 17,014  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HEWLETT PACKARD CO           | 207     | —     | —     | —       | コンピュータ・周辺機器             |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | —       | 213   | 337   | 36,639  | コンピュータ・周辺機器             |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 41      | 54    | 119   | 12,967  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HOLLYFRONTIER CORP           | 23      | 16    | 44    | 4,867   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HOLOGIC INC                  | 23      | 30    | 101   | 11,023  | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT                   | 142     | 144   | 1,972 | 213,965 | 専門小売り                   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL      | 82      | 84    | 952   | 103,341 | 航空宇宙・防衛                 |
| HORMEL FOODS CORP            | 13      | 35    | 139   | 15,085  | 食品                      |
| HOSPIRA INC                  | 19      | —     | —     | —       | 医薬品                     |
| HUDSON CITY BANCORP INC      | 67      | —     | —     | —       | 貯蓄・抵当・不動産金融             |
| HUMANA INC                   | 16      | 16    | 280   | 30,466  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC  | 9       | 9     | 75    | 8,191   | 陸運・鉄道                   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 100     | 83    | 81    | 8,813   | 銀行                      |
| IMS HEALTH HOLDINGS INC      | —       | 17    | 43    | 4,677   | ヘルスケア・テクノロジー            |
| IHS INC-CLASS A              | 8       | 8     | 100   | 10,861  | 専門サービス                  |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC      | 40      | 38    | 399   | 43,352  | 機械                      |

| 銘柄                                       | 株数  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等                   |
|------------------------------------------|-----|---------|-------|---------|-------------------------|
|                                          |     | 株 数     | 評 価 額 |         |                         |
|                                          |     |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                                   | 百株  | 百株      | 千米ドル  | 千円      |                         |
| ILLUMINA INC                             | 15  | 15      | 218   | 23,677  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| INCYTE CORP                              | 15  | 18      | 134   | 14,540  | バイオテクノロジー               |
| INTEL CORP                               | 531 | 540     | 1,609 | 174,533 | 半導体・半導体製造装置             |
| INTEGRYS ENERGY GROUP INC                | 7   | —       | —     | —       | 総合公益事業                  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC            | 12  | 13      | 341   | 37,012  | 各種金融サービス                |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES          | 103 | 105     | 1,554 | 168,594 | 情報技術サービス                |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE        | 8   | 8       | 106   | 11,572  | 化学                      |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)               | 43  | 43      | 184   | 19,968  | 容器・包装                   |
| INTERPUBLIC GROUP                        | 49  | 49      | 115   | 12,521  | メディア                    |
| INTUIT INC                               | 29  | 28      | 284   | 30,875  | ソフトウェア                  |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   | 4   | 4       | 255   | 27,742  | ヘルスケア機器・用品              |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC                | —   | 13      | 45    | 4,922   | バイオテクノロジー               |
| ISIS PHARMACEUTICALS INC                 | 13  | —       | —     | —       | バイオテクノロジー               |
| JPMORGAN CHASE & CO                      | 405 | 420     | 2,570 | 278,831 | 銀行                      |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC             | 12  | 12      | 62    | 6,782   | 建設・土木                   |
| JARDEN CORP                              | 21  | —       | —     | —       | 家庭用耐久財                  |
| JOHNSON & JOHNSON                        | 304 | 315     | 3,583 | 388,646 | 医薬品                     |
| JOHNSON CONTROLS INC                     | 75  | 75      | 305   | 33,148  | 自動車部品                   |
| JONES LANG LASALLE INC                   | —   | 4       | 53    | 5,783   | 不動産管理・開発                |
| JOY GLOBAL INC                           | 12  | —       | —     | —       | 機械                      |
| JUNIPER NETWORKS INC                     | 41  | 41      | 93    | 10,098  | 通信機器                    |
| KLA TENCOR CORP                          | 16  | 16      | 116   | 12,673  | 半導体・半導体製造装置             |
| KANSAS CITY SOUTHERN                     | 12  | 12      | 114   | 12,405  | 陸運・鉄道                   |
| KELLOGG CO                               | 30  | 30      | 226   | 24,514  | 食品                      |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC                | 13  | —       | —     | —       | 食品                      |
| KEYCORP                                  | 89  | 89      | 105   | 11,390  | 銀行                      |
| KIMBERLY-CLARK CORP                      | 39  | 42      | 540   | 58,645  | 家庭用品                    |
| KINDER MORGAN INC                        | 199 | 210     | 357   | 38,742  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KOHL'S CORP                              | 21  | 21      | 90    | 9,833   | 複合小売り                   |
| KRAFT HEINZ CO/THE                       | —   | 70      | 593   | 64,337  | 食品                      |
| KRAFT FOODS GROUP INC                    | 64  | —       | —     | —       | 食品                      |
| KROGER CO                                | 52  | 105     | 376   | 40,815  | 食品・生活必需品小売り             |
| L BRANDS, INC                            | 26  | 26      | 185   | 20,127  | 専門小売り                   |
| LKQ CORP                                 | 30  | 30      | 97    | 10,610  | 販売                      |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS                 | 8   | 8       | 120   | 13,121  | 航空宇宙・防衛                 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS             | 10  | 10      | 134   | 14,635  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH                             | 16  | 16      | 122   | 13,276  | 半導体・半導体製造装置             |
| LAS VEGAS SANDS CORP                     | 43  | 43      | 193   | 21,012  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A              | 26  | 26      | 250   | 27,145  | パーソナル用品                 |
| LEAR CORP                                | —   | 8       | 93    | 10,111  | 自動車部品                   |
| LEGGETT & PLATT INC                      | 14  | 14      | 69    | 7,529   | 家庭用耐久財                  |
| LEGG MASON INC                           | 13  | 13      | 40    | 4,372   | 資本市場                    |
| LENNAR CORP-A                            | 19  | 19      | 83    | 9,044   | 家庭用耐久財                  |
| LEUCADIA NATIONAL CORP                   | 31  | 31      | 51    | 5,621   | 各種金融サービス                |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC               | 30  | 36      | 184   | 20,053  | 各種電気通信サービス              |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A | 52  | 52      | 137   | 14,900  | インターネット販売・カタログ販売        |
| LIBERTY MEDIA CORP-A                     | 11  | —       | —     | —       | メディア                    |
| LIBERTY MEDIA CORP-C                     | 20  | —       | —     | —       | メディア                    |

| 銘柄                            | 株数  | 期首(前期末) | 当期    |         | 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      | 千米ドル  | 千円      |                         |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP        | —   | 11      | 37    | 4,077   | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C        | —   | 20      | 64    | 7,016   | メディア                    |
| ELI LILLY & CO.               | 110 | 112     | 846   | 91,823  | 医薬品                     |
| LINCOLN NATIONAL CORP         | 27  | 27      | 113   | 12,317  | 保険                      |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP        | 25  | 25      | 110   | 11,987  | 半導体・半導体製造装置             |
| LINKEDIN CORP - A             | 11  | 12      | 154   | 16,749  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| LOCKHEED MARTIN               | 29  | 31      | 766   | 83,147  | 航空宇宙・防衛                 |
| LOEWS CORP                    | 35  | 35      | 137   | 14,964  | 保険                      |
| LORILLARD INC                 | 38  | —       | —     | —       | タバコ                     |
| LOWES COS INC                 | 109 | 105     | 802   | 87,026  | 専門小売り                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC       | 10  | 15      | 96    | 10,417  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| M & T BANK CORP               | 12  | 16      | 190   | 20,628  | 銀行                      |
| MDU RESOURCES GROUP INC       | 15  | —       | —     | —       | 総合公益事業                  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL     | 50  | 57      | 124   | 13,508  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MSCI INC                      | —   | 11      | 84    | 9,116   | 各種金融サービス                |
| MACYS INC                     | 37  | 37      | 140   | 15,186  | 複合小売り                   |
| MANPOWERGROUP INC             | 9   | 9       | 74    | 8,077   | 専門サービス                  |
| MARATHON OIL CORP             | 72  | 79      | 90    | 9,802   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARATHON PETROLEUM CORP       | 30  | 61      | 213   | 23,123  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARKEL CORP                   | —   | 1       | 142   | 15,468  | 保険                      |
| MARSH & MCLENNAN COS          | 58  | 59      | 374   | 40,583  | 保険                      |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA    | 24  | 24      | 166   | 18,069  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS     | 5   | 5       | 103   | 11,267  | 建設資材                    |
| MASCO CORP                    | 35  | 35      | 111   | 12,041  | 建設関連製品                  |
| MASTERCARD INC-CLASS A        | 108 | 113     | 1,099 | 119,274 | 情報技術サービス                |
| MATTEL INC                    | 35  | 35      | 108   | 11,775  | レジャー用品                  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS     | 28  | 28      | 100   | 10,890  | 半導体・半導体製造装置             |
| MCCORMICK & CO INC.           | 11  | 14      | 137   | 14,937  | 食品                      |
| MCDONALD'S CORP               | 105 | 105     | 1,376 | 149,276 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MCGRAW HILL FINANCIAL INC     | 29  | —       | —     | —       | 各種金融サービス                |
| MCKESSON CORP                 | 24  | 26      | 463   | 50,246  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO     | 22  | 22      | 186   | 20,266  | 食品                      |
| MEADWESTVACO CORP             | 16  | —       | —     | —       | 容器・包装                   |
| MEDIVATION INC                | 9   | 18      | 117   | 12,752  | バイオテクノロジー               |
| MEDNAX INC                    | —   | 10      | 69    | 7,554   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR | —   | 10      | 14    | 1,563   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MERCK & CO INC                | 313 | 319     | 1,725 | 187,179 | 医薬品                     |
| METLIFE INC                   | 103 | 110     | 472   | 51,206  | 保険                      |
| METTLER-TOLEDO INTL           | 2   | 2       | 104   | 11,321  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| MICROSOFT CORP                | 852 | 864     | 4,326 | 469,203 | ソフトウェア                  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY          | 20  | 27      | 128   | 13,930  | 半導体・半導体製造装置             |
| MICRON TECHNOLOGY             | 117 | 117     | 115   | 12,524  | 半導体・半導体製造装置             |
| MOHAWK INDUSTRIES             | 6   | 6       | 133   | 14,452  | 家庭用耐久財                  |
| MOLSON COORS BREWING CO-B     | 15  | 20      | 199   | 21,610  | 飲料                      |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC    | 186 | 183     | 810   | 87,887  | 食品                      |
| MONSANTO CO                   | 53  | 51      | 457   | 49,632  | 化学                      |
| MONSTER BEVERAGE CORP         | 15  | —       | —     | —       | 飲料                      |
| MONSTER BEVERAGE CORP         | —   | 15      | 226   | 24,529  | 飲料                      |

| 銘柄                              | 株数  | 株数  | 当 期 末 |         | 業 種 等                   |
|---------------------------------|-----|-----|-------|---------|-------------------------|
|                                 |     |     | 評 価 額 |         |                         |
|                                 |     |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                          | 百株  | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                         |
| MOODYS CORP                     | 20  | 18  | 174   | 18,890  | 各種金融サービス                |
| MORGAN STANLEY                  | 161 | 165 | 430   | 46,708  | 資本市場                    |
| MOSAIC CO/THE                   | 36  | 36  | 91    | 9,896   | 化学                      |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC          | 26  | 16  | 113   | 12,289  | 通信機器                    |
| MURPHY OIL CORP                 | 17  | 17  | 51    | 5,536   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| NRG ENERGY INC                  | 40  | 40  | 62    | 6,789   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| NASDAQ INC                      | 14  | 14  | 91    | 9,933   | 各種金融サービス                |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC      | 48  | 41  | 130   | 14,142  | エネルギー設備・サービス            |
| NAVIENT CORP                    | 47  | 47  | 61    | 6,713   | 消費者金融                   |
| NETAPP INC                      | 32  | 32  | 73    | 7,986   | コンピュータ・周辺機器             |
| NETFLIX INC                     | 6   | 46  | 418   | 45,368  | インターネット販売・カタログ販売        |
| NETSUITE INC                    | 2   | 3   | 22    | 2,469   | ソフトウェア                  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD      | —   | 60  | 37    | 4,021   | 不動産管理・開発                |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD      | —   | 27  | 150   | 16,276  | コングロマリット                |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP      | 43  | 60  | 87    | 9,527   | 貯蓄・抵当・不動産金融             |
| NEWELL BRANDS INC               | 28  | 53  | 253   | 27,488  | 家庭用耐久財                  |
| NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO | 52  | 63  | 200   | 21,749  | 金属・鉱業                   |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I          | 43  | 43  | 52    | 5,727   | メディア                    |
| NEXTERA ENERGY INC              | 46  | 52  | 618   | 67,053  | 電力                      |
| NIKE INC-B                      | 75  | 156 | 916   | 99,352  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NISOURCE INC                    | 37  | —   | —     | —       | 総合公益事業                  |
| NOBLE ENERGY INC                | 39  | 51  | 179   | 19,492  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| NORDSTROM INC                   | 15  | 15  | 77    | 8,431   | 複合小売り                   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP           | 33  | 33  | 291   | 31,597  | 陸運・鉄道                   |
| NORTHERN TRUST CORP             | 25  | 26  | 184   | 19,975  | 資本市場                    |
| NORTHROP GRUMMAN CORP           | 20  | 19  | 424   | 46,091  | 航空宇宙・防衛                 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC       | 22  | 22  | 36    | 3,977   | ソフトウェア                  |
| NUCOR CORP                      | 34  | 34  | 161   | 17,493  | 金属・鉱業                   |
| NVIDIA CORP                     | 57  | 57  | 201   | 21,810  | 半導体・半導体製造装置             |
| OGE ENERGY CORP                 | 24  | 24  | 72    | 7,832   | 電力                      |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,         | 10  | 10  | 291   | 31,587  | 専門小売り                   |
| OCCIDENTAL PETE CORP            | 86  | 86  | 649   | 70,460  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| OCEANEERING INTL INC            | 13  | 8   | 28    | 3,085   | エネルギー設備・サービス            |
| OMNICARE INC                    | 9   | —   | —     | —       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| OMNICOM GROUP                   | 26  | 26  | 220   | 23,866  | メディア                    |
| ONEOK INC                       | 22  | 22  | 89    | 9,703   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ORACLE CORPORATION              | 384 | 366 | 1,440 | 156,244 | ソフトウェア                  |
| OWENS-ILLINOIS INC              | 23  | —   | —     | —       | 容器・包装                   |
| PG&E CORP                       | 51  | 56  | 331   | 35,908  | 電力                      |
| PNC FINANCIAL                   | 57  | 59  | 503   | 54,570  | 銀行                      |
| PPG INDUSTRIES                  | 15  | 30  | 329   | 35,774  | 化学                      |
| PPL CORPORATION                 | 72  | 72  | 276   | 30,018  | 電力                      |
| PVH CORP                        | 9   | 9   | 83    | 9,045   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| PACCAR                          | 38  | 38  | 214   | 23,317  | 機械                      |
| PACKAGING CORP OP AMERICA       | —   | 10  | 68    | 7,399   | 容器・包装                   |
| PALL CORP                       | 13  | —   | —     | —       | 機械                      |
| PALO ALTO NETWORKS INC          | 8   | 9   | 136   | 14,800  | 通信機器                    |
| PARKER HANNIFIN CORP            | 17  | 14  | 158   | 17,223  | 機械                      |

| 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    | 千米ドル  | 千円      |                         |
| PATTERSON COS INC             |   | 11      | 11    | 47    | 5,194   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PAYCHEX INC                   |   | 34      | 34    | 176   | 19,172  | 情報技術サービス                |
| PAYPAL HOLDINGS INC           |   | —       | 128   | 507   | 55,003  | 情報技術サービス                |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC  |   | 42      | 44    | 66    | 7,220   | 銀行                      |
| PEPCO HOLDINGS INC            |   | 24      | —     | —     | —       | 電力                      |
| PEPSICO INC                   |   | 162     | 166   | 1,753 | 190,235 | 飲料                      |
| PHARMACYCLICS INC             |   | 7       | —     | —     | —       | バイオテクノロジー               |
| PFIZER INC                    |   | 684     | 704   | 2,380 | 258,235 | 医薬品                     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   |   | 168     | 177   | 1,777 | 192,831 | タバコ                     |
| PHILLIPS 66                   |   | 60      | 62    | 487   | 52,836  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP    |   | 11      | 11    | 84    | 9,176   | 電力                      |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  |   | 16      | 18    | 295   | 32,090  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A    |   | —       | 24    | 21    | 2,347   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| POLARIS INDUSTRIES INC        |   | 6       | 6     | 56    | 6,126   | レジャー用品                  |
| PRAXAIR INC                   |   | 31      | 33    | 378   | 41,068  | 化学                      |
| PRECISION CASTPARTS CORP      |   | 15      | —     | —     | —       | 航空宇宙・防衛                 |
| T ROWE PRICE GROUP INC        |   | 27      | 27    | 205   | 22,300  | 資本市場                    |
| PRICELINE GROUP INC/THE       |   | 5       | 5     | 717   | 77,773  | インターネット販売・カタログ販売        |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     |   | 31      | 31    | 133   | 14,454  | 保険                      |
| PROCTER & GAMBLE CO           |   | 293     | 310   | 2,548 | 276,375 | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CO                |   | 66      | 66    | 218   | 23,729  | 保険                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      |   | 48      | 52    | 398   | 43,228  | 保険                      |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE         |   | 53      | 58    | 267   | 29,062  | 総合公益事業                  |
| PULTEGROUP INC                |   | 43      | 43    | 78    | 8,525   | 家庭用耐久財                  |
| QEP RESOURCES INC             |   | 23      | —     | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| QORVO INC                     |   | 16      | 16    | 76    | 8,263   | 半導体・半導体製造装置             |
| QUALCOMM INC                  |   | 179     | 173   | 885   | 96,069  | 半導体・半導体製造装置             |
| QUANTA SERVICES INC           |   | 25      | 25    | 58    | 6,293   | 建設・土木                   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC         |   | 16      | 16    | 129   | 14,029  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD  |   | 8       | 12    | 83    | 9,014   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| RACKSPACE HOSTING INC         |   | 11      | —     | —     | —       | インターネットソフトウェア・サービス      |
| RALPH LAUREN CORPORATION      |   | 6       | 6     | 57    | 6,268   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| RANGE RESOURCES CORP          |   | 18      | 18    | 76    | 8,321   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   |   | 12      | 12    | 62    | 6,772   | 資本市場                    |
| RAYTHEON COMPANY              |   | 33      | 33    | 432   | 46,901  | 航空宇宙・防衛                 |
| REALOGY HOLDINGS CORP         |   | 19      | 14    | 42    | 4,628   | 不動産管理・開発                |
| RED HAT INC                   |   | 19      | 19    | 141   | 15,328  | ソフトウェア                  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     |   | 8       | 8     | 322   | 35,022  | バイオテクノロジー               |
| REGIONS FINANCIAL CORP        |   | 147     | 147   | 133   | 14,428  | 銀行                      |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A    |   | 30      | 29    | 140   | 15,217  | 商業サービス・用品               |
| RESMED INC                    |   | 17      | 17    | 96    | 10,480  | ヘルスケア機器・用品              |
| REYNOLDS AMERICAN INC         |   | 33      | 97    | 483   | 52,476  | タバコ                     |
| RITE AID CORP                 |   | —       | 104   | 83    | 9,102   | 食品・生活必需品小売り             |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC |   | 14      | 14    | 55    | 6,047   | 専門サービス                  |
| ROCK-TENN COMPANY CL-A        |   | 15      | —     | —     | —       | 容器・包装                   |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       |   | 14      | 14    | 165   | 17,985  | 電気設備                    |
| ROCKWELL COLLINS INC          |   | 14      | 14    | 131   | 14,246  | 航空宇宙・防衛                 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        |   | 10      | 10    | 185   | 20,080  | コンピュータリット               |

| 銘柄                           | 株数  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等                   |
|------------------------------|-----|---------|-------|---------|-------------------------|
|                              |     | 株数      | 評 価 額 |         |                         |
|                              |     |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                         |
| (アメリカ)                       | 百株  | 百株      | 千米ドル  | 千円      |                         |
| ROSS STORES INC              | 21  | 49      | 284   | 30,909  | 専門小売り                   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 13  | 13      | 136   | 14,781  | 各種電気通信サービス              |
| S&P GLOBAL INC               | —   | 29      | 307   | 33,328  | 各種金融サービス                |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 14  | 14      | 67    | 7,341   | 資本市場                    |
| SPX CORP                     | 5   | —       | —     | —       | 機械                      |
| SABRE CORP                   | —   | 19      | 54    | 5,899   | 情報技術サービス                |
| ST JUDE MEDICAL INC          | 29  | 33      | 253   | 27,538  | ヘルスケア機器・用品              |
| SALESFORCE.COM INC           | 65  | 73      | 547   | 59,404  | ソフトウェア                  |
| SAN DISK CORPORATION         | 23  | 23      | 175   | 19,082  | コンピュータ・周辺機器             |
| SCANA CORP                   | 14  | 14      | 97    | 10,609  | 総合公益事業                  |
| HENRY SCHEIN INC             | 9   | 9       | 158   | 17,221  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD             | 139 | 159     | 1,162 | 126,045 | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB(CHARLES)CORP          | 132 | 133     | 362   | 39,337  | 資本市場                    |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 7   | 7       | 46    | 5,082   | メディア                    |
| SEALED AIR CORP              | 23  | 23      | 108   | 11,786  | 容器・包装                   |
| SEMPRA ENERGY                | 25  | 25      | 264   | 28,710  | 総合公益事業                  |
| SERVICENOW INC               | 14  | 19      | 128   | 13,895  | ソフトウェア                  |
| SHERWIN-WILLIAMS             | 8   | 8       | 256   | 27,850  | 化学                      |
| SIGMA-ALDRICH                | 12  | —       | —     | —       | 化学                      |
| SIGNATURE BANK               | —   | 5       | 69    | 7,514   | 銀行                      |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 269 | 269     | 105   | 11,466  | メディア                    |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 20  | 20      | 130   | 14,181  | 半導体・半導体製造装置             |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW        | 10  | 13      | 172   | 18,669  | 食品                      |
| SNAP-ON INC                  | 7   | 7       | 117   | 12,796  | 機械                      |
| SOUTHERN CO.                 | 96  | 103     | 513   | 55,644  | 電力                      |
| SOUTHWEST AIRLINES           | 21  | 15      | 63    | 6,863   | 旅客航空輸送業                 |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 39  | 39      | 44    | 4,877   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SPECTRA ENERGY CORP          | 73  | 73      | 226   | 24,599  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SPLUNK INC                   | —   | 13      | 62    | 6,750   | ソフトウェア                  |
| SPRINT CORP                  | 67  | 67      | 22    | 2,470   | 無線通信サービス                |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 15  | 18      | 201   | 21,883  | 機械                      |
| STAPLES INC                  | 74  | 74      | 76    | 8,266   | 専門小売り                   |
| STARBUCKS CORP               | 165 | 166     | 940   | 101,976 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS    | 20  | 17      | 139   | 15,159  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STATE STREET CORP            | 45  | 44      | 263   | 28,537  | 資本市場                    |
| STERICYCLE INC               | 8   | 8       | 83    | 9,059   | 商業サービス・用品               |
| STRYKER CORP                 | 38  | 37      | 411   | 44,672  | ヘルスケア機器・用品              |
| SUNTRUST BKS INC.            | 59  | 61      | 246   | 26,702  | 銀行                      |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 21  | —       | —     | —       | エネルギー設備・サービス            |
| SYMANTEC CORP                | 75  | 75      | 124   | 13,535  | ソフトウェア                  |
| SYNOPSIS INC                 | 17  | 17      | 81    | 8,848   | ソフトウェア                  |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 20  | 95      | 284   | 30,869  | 消費者金融                   |
| SYSCO CORP                   | 65  | 65      | 323   | 35,052  | 食品・生活必需品小売り             |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 33  | 28      | 79    | 8,649   | 資本市場                    |
| TECO ENERGY INC              | —   | 26      | 72    | 7,831   | 総合公益事業                  |
| TJX COS INC                  | 75  | 77      | 604   | 65,547  | 専門小売り                   |
| T-MOBILE US INC              | 26  | 33      | 131   | 14,280  | 無線通信サービス                |
| TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP | 11  | —       | —     | —       | 自動車部品                   |

| 銘柄                                   | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                         |
|--------------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|-------------------------|
|                                      |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                         |
|                                      |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                  |
| (アメリカ)                               |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                         |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A            |   | —       | 6     | 31    | 3,371   | ソフトウェア                  |
| TARGET CORP                          |   | 64      | 65    | 519   | 56,349  | 複合小売り                   |
| TEGNA INC                            |   | —       | 23    | 52    | 5,690   | メディア                    |
| TERADATA CORP                        |   | 14      | 14    | 39    | 4,248   | 情報技術サービス                |
| TESORO CORP                          |   | 13      | 13    | 99    | 10,839  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TESLA MOTORS INC                     |   | 9       | 10    | 227   | 24,698  | 自動車                     |
| TEXAS INSTRUMENTS INC                |   | 116     | 114   | 648   | 70,366  | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXTRON INC                          |   | 29      | 29    | 110   | 11,968  | 航空宇宙・防衛                 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC         |   | 43      | 45    | 665   | 72,130  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| 3M CORP                              |   | 65      | 70    | 1,189 | 129,040 | コングロマリット                |
| TIFFANY & CO                         |   | 13      | 13    | 95    | 10,379  | 専門小売り                   |
| TIME WARNER INC                      |   | 92      | 92    | 685   | 74,401  | メディア                    |
| TIME WARNER CABLE-A                  |   | 29      | 31    | 681   | 73,968  | メディア                    |
| TOLL BROTHERS INC                    |   | 22      | 14    | 37    | 4,048   | 家庭用耐久財                  |
| TORCHMARK CORP                       |   | 12      | 12    | 71    | 7,764   | 保険                      |
| TOWERS WATSON & CO-CL A              |   | 7       | —     | —     | —       | 専門サービス                  |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC            |   | 20      | 16    | 84    | 9,169   | 情報技術サービス                |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY               |   | 15      | 15    | 148   | 16,118  | 専門小売り                   |
| TRANSDIGM GROUP INC                  |   | 5       | 6     | 142   | 15,419  | 航空宇宙・防衛                 |
| TRAVELERS COS INC/THE                |   | 36      | 35    | 395   | 42,905  | 保険                      |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD               |   | 25      | 25    | 57    | 6,285   | 電子装置・機器・部品              |
| TRIPADVISOR INC                      |   | 13      | 13    | 82    | 8,895   | インターネット販売・カタログ販売        |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC         |   | 149     | 137   | 402   | 43,700  | メディア                    |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B |   | 48      | 48    | 141   | 15,305  | メディア                    |
| TWITTER INC                          |   | 45      | 71    | 100   | 10,934  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| TYSON FOODS INC-CL A                 |   | 31      | 35    | 242   | 26,274  | 食品                      |
| US BANCORP                           |   | 198     | 202   | 839   | 91,009  | 銀行                      |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR         |   | 6       | 6     | 127   | 13,791  | 専門小売り                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A             |   | 17      | 21    | 81    | 8,814   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C             |   | —       | 21    | 76    | 8,270   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNION PAC CORP                       |   | 95      | 98    | 833   | 90,412  | 陸運・鉄道                   |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC      |   | 8       | 8     | 39    | 4,263   | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B           |   | 77      | 78    | 803   | 87,097  | 航空貨物・物流サービス             |
| UNITED RENTALS INC                   |   | 10      | 10    | 64    | 7,015   | 商社・流通業                  |
| UNITED TECHNOLOGIES                  |   | 93      | 94    | 944   | 102,478 | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP             |   | —       | 4     | 54    | 5,931   | バイオテクノロジー               |
| UNITEDHEALTH GROUP INC               |   | 103     | 109   | 1,447 | 156,988 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B          |   | 9       | 9     | 125   | 13,624  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNUM GROUP                           |   | 26      | 26    | 87    | 9,444   | 保険                      |
| URBAN OUTFITTERS INC                 |   | 9       | —     | —     | —       | 専門小売り                   |
| V F CORP                             |   | 37      | 37    | 241   | 26,200  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VALERO ENERGY CORP                   |   | 58      | 57    | 313   | 33,989  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VANTIV INC - CL A                    |   | 19      | 19    | 105   | 11,488  | 情報技術サービス                |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC           |   | 10      | 10    | 85    | 9,261   | ヘルスケア機器・用品              |
| VERISIGN INC                         |   | 12      | 12    | 101   | 10,997  | インターネットソフトウェア・サービス      |
| VERIZON COMMUNICATIONS               |   | 450     | 464   | 2,370 | 257,062 | 各種電気通信サービス              |
| VERISK ANALYTICS INC                 |   | 15      | 17    | 136   | 14,845  | 専門サービス                  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS               |   | 26      | 29    | 259   | 28,175  | バイオテクノロジー               |

| 銘柄                           | 株数  | 期首(前期末) | 当期期末  |         | 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      | 千米ドル  | 千円      |                    |
| VIACOM INC-CLASS B           | 37  | 37      | 152   | 16,531  | メディア               |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 213 | 222     | 1,741 | 188,848 | 情報技術サービス           |
| VMWARE INC - CLASS A         | 10  | 10      | 55    | 6,006   | ソフトウェア             |
| VOYA FINANCIAL INC           | 25  | 25      | 75    | 8,180   | 各種金融サービス           |
| VULCAN MATERIALS CO          | 14  | 14      | 165   | 17,924  | 建設資材               |
| WABCO HOLDINGS INC           | —   | 5       | 61    | 6,722   | 機械                 |
| WEC ENERGY GROUP INC         | —   | 36      | 216   | 23,458  | 総合公益事業             |
| WABTEC CORP                  | 11  | 9       | 70    | 7,642   | 機械                 |
| WAL-MART STORES INC          | 174 | 183     | 1,267 | 137,451 | 食品・生活必需品小売り        |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 96  | 100     | 812   | 88,171  | 食品・生活必需品小売り        |
| WASTE CONNECTIONS INC        | —   | 13      | 89    | 9,742   | 商業サービス・用品          |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 46  | 53      | 324   | 35,180  | 商業サービス・用品          |
| WATERS CORP                  | 8   | 8       | 112   | 12,181  | ライフサイエンス・ツール/サービス  |
| WELLS FARGO CO               | 535 | 553     | 2,703 | 293,174 | 銀行                 |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 23  | 29      | 107   | 11,625  | コンピュータ・周辺機器        |
| WESTERN UNION CO             | 54  | 54      | 102   | 11,157  | 情報技術サービス           |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 6   | 6       | 29    | 3,167   | 化学                 |
| WESTROCK CO                  | —   | 28      | 117   | 12,777  | 容器・包装              |
| WHIRLPOOL CORP               | 8   | 8       | 154   | 16,711  | 家庭用耐久財             |
| WHITEWAVE FOODS CO - CL A    | —   | 18      | 74    | 8,131   | 食品                 |
| WHITING PETROLEUM CORP       | 23  | —       | —     | —       | 石油・ガス・消耗燃料         |
| WHOLE FOODS MARKET INC       | 40  | 40      | 121   | 13,154  | 食品・生活必需品小売り        |
| WILLIAMS COS                 | 75  | 73      | 138   | 14,995  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| WISCONSIN ENERGY CORP        | 23  | —       | —     | —       | 総合公益事業             |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 11  | 11      | 77    | 8,455   | ソフトウェア             |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 12  | 12      | 89    | 9,682   | ホテル・レストラン・レジャー     |
| WYNN RESORTS LTD             | 9   | 9       | 82    | 8,942   | ホテル・レストラン・レジャー     |
| XCEL ENERGY INC              | 54  | 54      | 222   | 24,106  | 電力                 |
| XILINX INC                   | 32  | 26      | 111   | 12,145  | 半導体・半導体製造装置        |
| XEROX CORP                   | 128 | 100     | 93    | 10,141  | 情報技術サービス           |
| XYLEM INC                    | 18  | 18      | 74    | 8,121   | 機械                 |
| YAHOO! INC                   | 99  | 101     | 375   | 40,728  | インターネットソフトウェア・サービス |
| YUM BRANDS INC               | 46  | 50      | 414   | 44,936  | ホテル・レストラン・レジャー     |
| ZILLOW GROUP INC - A         | 5   | —       | —     | —       | インターネットソフトウェア・サービス |
| ZILLOW GROUP INC - C         | —   | 11      | 29    | 3,217   | インターネットソフトウェア・サービス |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 17  | 20      | 232   | 25,255  | ヘルスケア機器・用品         |
| ZOETIS INC                   | 53  | 54      | 256   | 27,819  | 医薬品                |
| ACTAVIS PLC                  | 41  | —       | —     | —       | 医薬品                |
| ALKERMES PLC                 | 16  | 16      | 65    | 7,072   | バイオテクノロジー          |
| ALLERGAN PLC                 | —   | 45      | 970   | 105,232 | 医薬品                |
| AON PLC                      | 30  | 30      | 322   | 34,979  | 保険                 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 13  | 13      | 93    | 10,155  | 保険                 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 10  | 10      | 54    | 5,906   | 保険                 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | —   | 12      | 33    | 3,683   | 化学                 |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 69  | 72      | 832   | 90,297  | 情報技術サービス           |
| BUNGE LIMITED                | 16  | 16      | 97    | 10,595  | 食品                 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 31  | 32      | 224   | 24,301  | 自動車部品              |
| EATON CORP PLC               | 53  | 53      | 321   | 34,869  | 電気設備               |

| 銘<br>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     | 千米ドル   | 千円      |                |
| ENDO INTERNATIONAL PLC                 |  | 18        | 21     | 32     | 3,544   | 医薬品            |
| ENSCO PLC-CL A                         |  | 25        | —      | —      | —       | エネルギー設備・サービス   |
| EVEREST RE GROUP LTD                   |  | 4         | 4      | 79     | 8,625   | 保険             |
| INGERSOLL-RAND PLC                     |  | 28        | 28     | 182    | 19,815  | 機械             |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC          |  | 85        | 85     | 44     | 4,858   | エネルギー設備・サービス   |
| INVESCO LTD                            |  | 45        | 45     | 132    | 14,417  | 資本市場           |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC               |  | 7         | 7      | 115    | 12,494  | 医薬品            |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A                   |  | 25        | 25     | 96     | 10,454  | メディア           |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C           |  | 71        | 63     | 228    | 24,790  | メディア           |
| MALLINCKRODT PLC                       |  | 11        | 11     | 70     | 7,594   | 医薬品            |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD           |  | 47        | 47     | 45     | 4,924   | 半導体・半導体製造装置    |
| MEDTRONIC PLC                          |  | 153       | 162    | 1,302  | 141,231 | ヘルスケア機器・用品     |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD              |  | 22        | 22     | 112    | 12,147  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NABORS INDUSTRIES INC                  |  | 37        | —      | —      | —       | エネルギー設備・サービス   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC                   |  | —         | 36     | 186    | 20,186  | 専門サービス         |
| NOBLE CORP PLC                         |  | 30        | —      | —      | —       | エネルギー設備・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN           |  | 11        | 15     | 73     | 8,012   | ホテル・レストラン・レジャー |
| PARTNERRE LTD                          |  | 4         | —      | —      | —       | 保険             |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD             |  | 4         | 4      | 55     | 6,047   | 保険             |
| SEAGATE TECHNOLOGY                     |  | 33        | 33     | 63     | 6,934   | コンピュータ・周辺機器    |
| PENTAIR PLC                            |  | 19        | 19     | 113    | 12,352  | 機械             |
| SIGNET JEWELERS LTD                    |  | 9         | 9      | 104    | 11,322  | 専門小売り          |
| TYCO INTERNATIONAL PLC                 |  | 44        | 44     | 165    | 17,981  | 商業サービス・用品      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC               |  | —         | 15     | 196    | 21,287  | 保険             |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC              |  | 16        | —      | —      | —       | 保険             |
| PERRIGO CO PLC                         |  | 14        | 16     | 156    | 16,986  | 医薬品            |
| XL GROUP PLC                           |  | 32        | 32     | 106    | 11,574  | 保険             |
| ACE LTD                                |  | 35        | —      | —      | —       | 保険             |
| CHUBB LTD                              |  | —         | 52     | 639    | 69,314  | 保険             |
| GARMIN LTD                             |  | 15        | 15     | 60     | 6,574   | 家庭用耐久財         |
| TE CONNECTIVITY LTD                    |  | 44        | 44     | 259    | 28,191  | 電子装置・機器・部品     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. |  | —         | 7      | 57     | 6,262   | ソフトウェア         |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD     |  | —         | 0.8    | 10     | 1,155   | 医薬品            |
| AERCAP HOLDINGS NV                     |  | —         | 9      | 36     | 3,905   | 商社・流通業         |
| CORE LABORATORIES N.V.                 |  | 3         | 3      | 47     | 5,135   | エネルギー設備・サービス   |
| MOBILEYE NV                            |  | —         | 9      | 31     | 3,457   | ソフトウェア         |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A               |  | 46        | 42     | 340    | 36,970  | 化学             |
| MYLAN NV                               |  | 45        | 45     | 186    | 20,252  | 医薬品            |
| NIELSEN NV                             |  | 36        | —      | —      | —       | 専門サービス         |
| NXP SEMICONDUCTORS NV                  |  | —         | 16     | 143    | 15,587  | 半導体・半導体製造装置    |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING           |  | 15        | 16     | 55     | 6,006   | 電気設備           |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD            |  | 19        | 19     | 146    | 15,852  | ホテル・レストラン・レジャー |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD                 |  | 27        | —      | —      | —       | 半導体・半導体製造装置    |
| BROADCOM LTD                           |  | —         | 45     | 640    | 69,501  | 半導体・半導体製造装置    |
| FLEXTRONICS INTL LTD                   |  | 68        | 68     | 82     | 8,931   | 電子装置・機器・部品     |
| 小 計                                    |  | 株 数 ・ 金 額 | 33,976 | 35,573 | 207,685 | 22,525,529     |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                          |  |           | 592    | 597    | —       | <62.4%>        |

| 銘柄                                 | 株数  | 期首(前期末) | 当期     |        | 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     |                         |
| ARC RESOURCES LTD                  | 38  | 38      | 78     | 6,575  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| AGNICO EAGLE MINES LTD             | 20  | 28      | 160    | 13,383 | 金属・鉱業                   |
| AGRIUM INC                         | 15  | 15      | 168    | 14,111 | 化学                      |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B         | 45  | 45      | 244    | 20,444 | 食品・生活必需品小売り             |
| ALTAGAS LTD                        | 15  | 15      | 43     | 3,646  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ATCO LTD CL1                       | 9   | 9       | 37     | 3,160  | 総合公益事業                  |
| BCE INC                            | 13  | 19      | 112    | 9,394  | 各種電気通信サービス              |
| BANK OF MONTREAL                   | 69  | 71      | 571    | 47,763 | 銀行                      |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX        | 134 | 139     | 857    | 71,677 | 銀行                      |
| BARRICK GOLD                       | 123 | 140     | 315    | 26,354 | 金属・鉱業                   |
| BAYTEX ENERGY CORP                 | 22  | —       | —      | —      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BLACKBERRY LTD                     | 45  | 45      | 38     | 3,201  | コンピュータ・周辺機器             |
| BOMBARDIER B SHEARS                | 195 | 195     | 38     | 3,243  | 航空宇宙・防衛                 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A       | 62  | 98      | 426    | 35,642 | 不動産管理・開発                |
| CAE INC                            | 34  | 34      | 51     | 4,336  | 航空宇宙・防衛                 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B          | —   | 2       | 65     | 5,495  | 容器・包装                   |
| CI FINANCIAL CORP                  | 21  | 31      | 82     | 6,890  | 資本市場                    |
| CAMECO CORP                        | 50  | 50      | 75     | 6,277  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 43  | 44      | 435    | 36,378 | 銀行                      |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO           | 89  | 93      | 705    | 59,011 | 陸運・鉄道                   |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD     | 116 | 129     | 462    | 38,635 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CANADIAN OIL SANDS LTD             | 64  | —       | —      | —      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD       | 18  | 15      | 276    | 23,104 | 陸運・鉄道                   |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A           | 7   | 7       | 101    | 8,468  | 複合小売り                   |
| CANADIAN UTILITIES LTD A           | 10  | 10      | 39     | 3,291  | 総合公益事業                  |
| CATAMARAN CORP                     | 21  | —       | —      | —      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENOVUS ENERGY INC                 | 89  | 89      | 165    | 13,807 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC         | 2   | 2       | 108    | 9,103  | ソフトウェア                  |
| CONSTELLATION SOFTWARE-RIGHTS      | 2   | —       | —      | —      | ソフトウェア                  |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP         | 47  | 47      | 91     | 7,672  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DOLLARAMA INC                      | 11  | 15      | 142    | 11,890 | 複合小売り                   |
| ELDORADO GOLD CORPORATION          | 97  | 97      | 52     | 4,410  | 金属・鉱業                   |
| ELEMENT FINANCIAL CORP             | —   | 40      | 58     | 4,915  | 各種金融サービス                |
| EMPIRE CO LTD A                    | 5   | 13      | 27     | 2,302  | 食品・生活必需品小売り             |
| ENCANA CORP                        | 75  | 99      | 76     | 6,396  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ENBRIDGE INC                       | 92  | 105     | 524    | 43,823 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ENERPLUS CORP                      | 25  | —       | —      | —      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD        | 2   | 2       | 169    | 14,145 | 保険                      |
| FINNING INTERNATIONAL INC          | 20  | 20      | 41     | 3,509  | 商社・流通業                  |
| FIRST CAPITAL REALTY INC           | 11  | 11      | 22     | 1,901  | 不動産管理・開発                |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD         | 59  | 83      | 66     | 5,536  | 金属・鉱業                   |
| FORTIS INC                         | 30  | 30      | 120    | 10,045 | 電力                      |
| FRANCO-NEVADA CORP                 | 18  | 18      | 157    | 13,124 | 金属・鉱業                   |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC              | 24  | 24      | 96     | 8,041  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| GOLDCORP INC                       | 95  | 101     | 238    | 19,966 | 金属・鉱業                   |
| GREAT-WEST LIFE CO INC             | 34  | 34      | 116    | 9,697  | 保険                      |
| CGI GROUP INC - CLASS A            | 22  | 22      | 127    | 10,682 | 情報技術サービス                |
| HUSKY ENERGY INC                   | 37  | 37      | 55     | 4,671  | 石油・ガス・消耗燃料              |

| 銘<br>柄                                | 株<br>数 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等        |
|---------------------------------------|--------|---------|-------------|---------|--------------------|
|                                       |        | 株<br>数  | 評<br>価<br>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      |                    |
| IGM FINANCIAL INC                     | 13     | 13      | 48          | 4,015   | 資本市場               |
| IMPERIAL OIL                          | 29     | 29      | 121         | 10,127  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC          | 8      | 8       | 32          | 2,742   | 保険                 |
| INTACT FINANCIAL CORP                 | 14     | 14      | 125         | 10,484  | 保険                 |
| INTER PIPELINE LTD                    | 38     | 38      | 95          | 7,988   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A          | 9      | 9       | 17          | 1,435   | 食品・生活必需品小売り        |
| KEYERA CORP                           | 20     | 20      | 73          | 6,163   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| KINROSS GOLD CORP                     | 165    | 165     | 111         | 9,309   | 金属・鉱業              |
| LINAMAR CORP                          | —      | 5       | 26          | 2,231   | 自動車部品              |
| LOBLAW COMPANIES                      | 24     | 24      | 165         | 13,846  | 食品・生活必需品小売り        |
| MEG ENERGY CORP                       | 18     | —       | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料         |
| MAGNA INTERNATIONAL INC               | 44     | 44      | 235         | 19,659  | 自動車部品              |
| MANULIFE FINANCIAL CORP               | 211    | 233     | 422         | 35,330  | 保険                 |
| METHANEX CORP                         | 9      | 9       | 37          | 3,115   | 化学                 |
| METRO INC                             | 24     | 24      | 104         | 8,726   | 食品・生活必需品小売り        |
| NATIONAL BANK OF CANADA               | 33     | 35      | 143         | 11,989  | 銀行                 |
| NEW GOLD INC                          | 85     | —       | —           | —       | 金属・鉱業              |
| ONEX CORP                             | 9      | 9       | 69          | 5,783   | 各種金融サービス           |
| OPEN TEXT CORP                        | 14     | 14      | 99          | 8,346   | ソフトウェア             |
| PARAMOUNT RESOURCES LTD.              | 7      | —       | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PEMBINA PIPELINE CORP                 | 37     | 47      | 170         | 14,284  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP          | 18     | 18      | 54          | 4,542   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC       | 93     | 98      | 198         | 16,580  | 化学                 |
| POWER CORPORATION OF CANADA           | 37     | 37      | 106         | 8,919   | 保険                 |
| POWER FINANCIAL CORP                  | 29     | 29      | 90          | 7,546   | 保険                 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD                | 16     | 16      | 38          | 3,185   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS           | —      | 15      | 64          | 5,392   | 商業サービス・用品          |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC   | 18     | 25      | 137         | 11,460  | ホテル・レストラン・レジャー     |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B            | 41     | 41      | 201         | 16,827  | 無線通信サービス           |
| ROYAL BANK OF CANADA                  | 155    | 171     | 1,293       | 108,090 | 銀行                 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC                 | 18     | 18      | 89          | 7,517   | 建設・土木              |
| SAPUTO INC                            | 28     | 28      | 113         | 9,528   | 食品                 |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A          | —      | 17      | 41          | 3,454   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B             | 48     | 52      | 123         | 10,319  | メディア               |
| SILVER WHEATON CORP                   | 44     | 44      | 103         | 8,683   | 金属・鉱業              |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                | 68     | 72      | 303         | 25,397  | 保険                 |
| SUNCOR ENERGY INC                     | 160    | 185     | 614         | 51,402  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TALISMAN ENERGY                       | 102    | —       | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TECK RESOURCES LTD                    | 57     | 57      | 68          | 5,708   | 金属・鉱業              |
| TELUS CORP                            | 29     | 26      | 103         | 8,684   | 各種電気通信サービス         |
| THOMSON REUTERS CORP                  | 42     | 36      | 189         | 15,879  | メディア               |
| TORONTO DOMINION BANK                 | 198    | 213     | 1,178       | 98,548  | 銀行                 |
| TOURMALINE OIL CORP                   | 17     | 17      | 50          | 4,250   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TRANSALTA CORP                        | 23     | —       | —           | —       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| TRANSCANADA CORP                      | 80     | 82      | 419         | 35,060  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD          | 87     | 87      | 29          | 2,476   | 金属・鉱業              |
| VALÉANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 34     | 38      | 141         | 11,826  | 医薬品                |
| VERESEN INC                           | —      | 30      | 27          | 2,284   | 石油・ガス・消耗燃料         |

| 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        |              |
| VERMILION ENERGY INC          |               | 14      | 14    | 57     | 4,831     | 石油・ガス・消耗燃料   |
| WEST FRASER TIMBER            |               | 7       | 7     | 32     | 2,724     | 紙製品・林産品      |
| WESTON(GEORGE)LTD             |               | 4       | 4     | 49     | 4,148     | 食品・生活必需品小売り  |
| YAMANA GOLD INC               |               | 127     | 127   | 71     | 5,976     | 金属・鉱業        |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額     | 4,496   | 4,516 | 15,946 | 1,332,963 |              |
|                               | 銘 柄 数 < 比 率 > | 94      | 90    | —      | <3.7%>    |              |
| (イギリス)                        |               |         |       | 千英ポンド  |           |              |
| ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC |               | 103     | 103   | 27     | 4,234     | 資本市場         |
| AMEC FOSTER WHEELER PLC PLC   |               | 45      | —     | —      | —         | エネルギー設備・サービス |
| ANTOFAGASTA PLC               |               | 51      | 51    | 21     | 3,319     | 金属・鉱業        |
| ASHTREAD GROUP PLC            |               | 61      | 61    | 53     | 8,321     | 商社・流通業       |
| BHP BILLITON PLC              |               | 231     | 242   | 191    | 29,998    | 金属・鉱業        |
| ARM HOLDINGS PLC              |               | 153     | 153   | 145    | 22,712    | 半導体・半導体製造装置  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC      |               | —       | 105   | 55     | 8,736     | 家庭用耐久財       |
| SKY PLC                       |               | 111     | 111   | 104    | 16,399    | メディア         |
| TULLOW OIL PLC                |               | 82      | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料   |
| AVIVA PLC                     |               | 422     | 470   | 200    | 31,315    | 保険           |
| CRODA INTERNATIONAL PLC       |               | 16      | —     | —      | —         | 化学           |
| DIAGEO PLC                    |               | 278     | 290   | 549    | 85,827    | 飲料           |
| SCHRODERS PLC                 |               | 12      | 12    | 29     | 4,610     | 資本市場         |
| BAE SYSTEMS PLC               |               | 341     | 341   | 167    | 26,168    | 航空宇宙・防衛      |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC  |               | 201     | 214   | 901    | 140,897   | タバコ          |
| STANDARD CHARTERED PLC        |               | 270     | 390   | 186    | 29,090    | 銀行           |
| IMPERIAL BRANDS PLC           |               | 102     | 108   | 409    | 64,027    | タバコ          |
| SABMILLER PLC                 |               | 106     | 112   | 473    | 73,933    | 飲料           |
| HSBC HOLDINGS PLC             |               | 2,081   | 2,240 | 962    | 150,457   | 銀行           |
| LEGAL & GENERAL               |               | 641     | 641   | 139    | 21,865    | 保険           |
| MEGGITT PLC                   |               | 96      | 96    | 38     | 6,090     | 航空宇宙・防衛      |
| MORRISON SUPERMARKETS         |               | 203     | 200   | 38     | 5,966     | 食品・生活必需品小売り  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC  |               | 41      | 42    | 133    | 20,791    | 食品           |
| PEARSON                       |               | 88      | 88    | 71     | 11,131    | メディア         |
| PERSIMMON PLC                 |               | 30      | 38    | 74     | 11,691    | 家庭用耐久財       |
| PRUDENTIAL PLC                |               | 284     | 285   | 370    | 57,938    | 保険           |
| RIO TINTO PLC-REG             |               | 140     | 145   | 284    | 44,511    | 金属・鉱業        |
| ST JAMES S PLACE PLC          |               | —       | 64    | 55     | 8,710     | 保険           |
| TRAVIS PERKINS PLC            |               | 24      | 24    | 44     | 6,945     | 商社・流通業       |
| SSE PLC                       |               | 106     | 120   | 180    | 28,258    | 電力           |
| BP PLC                        |               | 1,972   | 2,100 | 738    | 115,343   | 石油・ガス・消耗燃料   |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC      |               | 6,310   | 6,400 | 411    | 64,374    | 銀行           |
| TATE & LYLE ORD.              |               | 55      | 55    | 33     | 5,251     | 食品           |
| BG GROUP PLC                  |               | 369     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料   |
| TAYLOR WIMPEY PLC             |               | —       | 343   | 63     | 9,861     | 家庭用耐久財       |
| TESCO PLC                     |               | 882     | 882   | 138    | 21,610    | 食品・生活必需品小売り  |
| SMITH & NEPHEW PLC            |               | 97      | 97    | 113    | 17,658    | ヘルスケア機器・用品   |
| GLAXOSMITHKLINE PLC           |               | 525     | 559   | 818    | 127,966   | 医薬品          |
| WEIR GROUP PLC                |               | 27      | 27    | 29     | 4,640     | 機械           |
| BABCOCK INTL GROUP PLC        |               | 33      | 33    | 31     | 4,849     | 商業サービス・用品    |
| ASTRAZENECA PLC               |               | 136     | 146   | 575    | 89,989    | 医薬品          |

| 銘柄                            | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等          |
|-------------------------------|-------|---------|-------|---------|----------------|
|                               |       | 株数      | 評 価 額 |         |                |
|                               |       |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                |
| (イギリス)                        | 百株    | 百株      | 千英ポンド | 千円      |                |
| GKN PLC                       | 208   | 160     | 43    | 6,845   | 自動車部品          |
| BT GROUP PLC                  | 892   | 980     | 432   | 67,509  | 各種電気通信サービス     |
| CARNIVAL PLC                  | 18    | 22      | 77    | 12,138  | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER PLC           | 172   | 172     | 72    | 11,253  | 複合小売り          |
| BARCLAYS PLC                  | 1,819 | 1,960   | 310   | 48,528  | 銀行             |
| INTERTEK GROUP PLC            | 15    | 21      | 68    | 10,707  | 専門サービス         |
| WILLIAM HILL PLC              | 119   | 79      | 25    | 3,932   | ホテル・レストラン・レジャー |
| BURBERRY GROUP PLC            | 47    | 47      | 55    | 8,636   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEXT PLC                      | 17    | 17      | 92    | 14,478  | 複合小売り          |
| KINGFISHER PLC                | 259   | 259     | 94    | 14,695  | 専門小売り          |
| ICAP PLC                      | 58    | 58      | 27    | 4,222   | 資本市場           |
| ITV PLC                       | 429   | 429     | 94    | 14,788  | メディア           |
| SAINSBURY                     | 117   | 180     | 47    | 7,431   | 食品・生活必需品小売り    |
| RANDGOLD RESOURCES LTD        | 10    | 10      | 60    | 9,467   | 金属・鉱業          |
| G4S PLC                       | 161   | 161     | 31    | 4,860   | 商業サービス・用品      |
| ADMIRAL GROUP PLC             | 17    | 28      | 53    | 8,361   | 保険             |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS     | —     | 14      | 41    | 6,527   | 家庭用耐久財         |
| CENTRICA PLC                  | 556   | 556     | 116   | 18,244  | 総合公益事業         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS   | 423   | 453     | 771   | 120,548 | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B       | 270   | 455     | 782   | 122,217 | 石油・ガス・消耗燃料     |
| BUNZLE                        | 32    | 41      | 84    | 13,248  | 商社・流通業         |
| COBHAM PLC                    | 113   | 113     | 18    | 2,862   | 航空宇宙・防衛        |
| NATIONAL GRID PLC             | 408   | 423     | 423   | 66,197  | 総合公益事業         |
| INMARSAT PLC                  | 38    | 55      | 45    | 7,051   | 各種電気通信サービス     |
| PETROFAC LTD                  | 34    | 34      | 27    | 4,250   | エネルギー設備・サービス   |
| LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC | 35    | 35      | 90    | 14,137  | 各種金融サービス       |
| UNILEVER PLC                  | 141   | 149     | 470   | 73,445  | パーソナル用品        |
| TUI AG-DI                     | 44    | 60      | 62    | 9,722   | ホテル・レストラン・レジャー |
| INVESTEC PLC                  | 62    | 62      | 29    | 4,640   | 資本市場           |
| EXPERIAN PLC                  | 107   | 107     | 134   | 21,033  | 専門サービス         |
| MONDI PLC                     | —     | 39      | 50    | 7,928   | 紙製品・林産品        |
| SEVERN TRENT PLC              | 27    | 27      | 60    | 9,492   | 水道             |
| WHITBREAD PLC                 | 19    | 19      | 74    | 11,578  | ホテル・レストラン・レジャー |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL   | 37    | 37      | 14    | 2,188   | 専門小売り          |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC       | 21    | 23      | 28    | 4,521   | 資本市場           |
| SMITHS GROUP PLC              | 47    | 47      | 50    | 7,953   | コングロマリット       |
| ANGLO AMERICAN PLC            | 151   | 151     | 84    | 13,201  | 金属・鉱業          |
| 3I GROUP PLC                  | 93    | 93      | 43    | 6,748   | 資本市場           |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC       | —     | 15      | 42    | 6,654   | 消費者金融          |
| CAPITA PLC                    | 69    | 69      | 70    | 11,040  | 専門サービス         |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC   | 71    | 73      | 503   | 78,737  | 家庭用品           |
| RELX PLC                      | 122   | 122     | 150   | 23,562  | メディア           |
| SHIRE PLC                     | 63    | 69      | 280   | 43,871  | 医薬品            |
| FRESNILLO PLC                 | 27    | 27      | 28    | 4,383   | 金属・鉱業          |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC    | 73    | 73      | 68    | 10,762  | 水道             |
| GLENORE PLC                   | 1,238 | 1,320   | 174   | 27,340  | 金属・鉱業          |
| DIXONS CARPHONE PLC           | 92    | 92      | 38    | 6,007   | 専門小売り          |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC      | 204   | 204     | 130   | 20,465  | 航空宇宙・防衛        |

| 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     | 千英ポンド   | 千円        |                         |
| JOHNSON MATTHEY PLC                |               | 21      | —      | —       | —         | 化学                      |
| OLD MUTUAL PLC                     |               | 559     | 570    | 98      | 15,382    | 保険                      |
| EASYJET PLC                        |               | 19      | 19     | 27      | 4,364     | 旅客航空輸送業                 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP       |               | 287     | 357    | 76      | 11,876    | 銀行                      |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP        |               | 145     | —      | —       | —         | 保険                      |
| SAGE GROUP PLC (THE)               |               | 131     | 130    | 77      | 12,046    | ソフトウェア                  |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC       |               | —       | 44     | 38      | 5,950     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WPP PLC                            |               | 143     | 143    | 230     | 35,998    | メディア                    |
| COCA-COLA HBC AG-CDI               |               | 19      | 19     | 26      | 4,141     | 飲料                      |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT |               | —       | 14,484 | 1       | 226       | 航空宇宙・防衛                 |
| ROYAL MAIL PLC                     |               | 77      | 120    | 59      | 9,294     | 航空貨物・物流サービス             |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI       |               | 62      | 62     | 26      | 4,212     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WOLSELEY PLC                       |               | 27      | 27     | 108     | 16,967    | 商社・流通業                  |
| IMI PLC                            |               | 35      | 35     | 33      | 5,302     | 機械                      |
| VODAFONE GROUP PLC                 |               | 2,856   | 3,050  | 667     | 104,326   | 無線通信サービス                |
| AGGREKO PLC                        |               | 27      | 27     | 27      | 4,366     | 商業サービス・用品               |
| RSA INSURANCE GROUP PLC            |               | 122     | 122    | 58      | 9,162     | 保険                      |
| COMPASS GROUP PLC                  |               | 188     | 186    | 233     | 36,562    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| REXAM PLC                          |               | 91      | 72     | 45      | 7,071     | 容器・包装                   |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC  |               | 28      | —      | —       | —         | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MELROSE INDUSTRIES PLC             |               | 140     | —      | —       | —         | 機械                      |
| STANDARD LIFE PLC                  |               | 226     | 250    | 80      | 12,532    | 保険                      |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT |               | 28,764  | —      | —       | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| AUTO TRADER GROUP PLC              |               | —       | 130    | 49      | 7,686     | インターネットソフトウェア・サービス      |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP        |               | —       | 132    | 50      | 7,892     | 保険                      |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC  |               | —       | 25     | 67      | 10,547    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WORLDPAY GROUP PLC                 |               | —       | 120    | 31      | 4,895     | 情報技術サービス                |
| CRODA INTERNATIONAL PLC            |               | —       | 15     | 46      | 7,201     | 化学                      |
| JOHNSON MATTHEY PLC                |               | —       | 19     | 56      | 8,824     | 化学                      |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額     | 59,671  | 47,190 | 17,667  | 2,760,756 |                         |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 104     | 109    | —       | <7.7%>    |                         |
| (スイス)                              |               |         |        | 千スイスフラン |           |                         |
| SYNGENTA AG-REG                    |               | 10      | 10     | 399     | 44,650    | 化学                      |
| SIKA AG-BR                         |               | 0.22    | 0.22   | 90      | 10,053    | 化学                      |
| SGS SA-REG                         |               | 0.66    | 0.65   | 135     | 15,152    | 専門サービス                  |
| SULZER AG-REG                      |               | 3       | 1      | 12      | 1,406     | 機械                      |
| BARRY CALLEBAUT AG                 |               | 0.22    | 0.22   | 25      | 2,830     | 食品                      |
| SWISSCOM AG-REG                    |               | 2       | 2      | 134     | 15,003    | 各種電気通信サービス              |
| LINDT & SPRUENGLI AG-PC            |               | 0.09    | 0.09   | 54      | 6,127     | 食品                      |
| LINDT&SPRUENGLI AG-REG             |               | 0.01    | 0.01   | 72      | 8,047     | 食品                      |
| GIVAUDAN-REG                       |               | 1       | 1      | 191     | 21,435    | 化学                      |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG          |               | 16      | 16     | 356     | 39,868    | 保険                      |
| NOVARTIS-REG                       |               | 249     | 260    | 1,873   | 209,247   | 医薬品                     |
| ABB LTD                            |               | 234     | 256    | 508     | 56,847    | 電気設備                    |
| ROCHE HOLDINGS (GENUSSSCHEINE)     |               | 76      | 80     | 1,928   | 215,447   | 医薬品                     |
| ADECCO SA-REG                      |               | 18      | 18     | 116     | 13,057    | 専門サービス                  |
| LAFARGEHOLCIM LTD                  |               | 26      | 49     | 211     | 23,584    | 建設資材                    |
| NESTLE SA-REG                      |               | 350     | 363    | 2,597   | 290,187   | 食品                      |

| 銘<br>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            |
| (スイス)                               |               | 百株      | 百株    | 千スイスフラン     | 千円        |                   |
| BALOISE HOLDING AG                  |               | 5       | 5     | 67          | 7,495     | 保険                |
| SONOVA HOLDING AG-REG               |               | 6       | 7     | 96          | 10,825    | ヘルスケア機器・用品        |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG          |               | 162     | 207   | 278         | 31,052    | 資本市場              |
| THE SWATCH GROUP AG-B               |               | 3       | 3     | 107         | 12,023    | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| THE SWATCH GROUP AG-REG             |               | 5       | 5     | 34          | 3,815     | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| LONZA AG-REG                        |               | 5       | 6     | 111         | 12,418    | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SWISS LIFE HOLDING AG               |               | 4       | 4     | 95          | 10,620    | 保険                |
| GALENICA AG-REG                     |               | —       | 0.41  | 60          | 6,704     | 医薬品               |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG           |               | 1       | 1     | 56          | 6,299     | 化学                |
| SWISS PRIME SITE-REG                |               | 7       | 7     | 63          | 7,075     | 不動産管理・開発          |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES    |               | 2       | 2     | 17          | 1,995     | 各種金融サービス          |
| DUFREY AG-REG                       |               | —       | 5     | 68          | 7,690     | 専門小売り             |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG           |               | 1       | 1     | 63          | 7,121     | 資本市場              |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT         |               | 4       | 4     | 75          | 8,386     | 機械                |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG            |               | 2       | 2     | 50          | 5,684     | 機械                |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG          |               | 6       | 6     | 84          | 9,415     | 海運業               |
| GEBERIT AG-REG                      |               | 4       | 4     | 145         | 16,290    | 建設関連製品            |
| ACTELION LTD                        |               | 11      | 11    | 173         | 19,391    | バイオテクノロジー         |
| ARYZTA AG                           |               | 8       | 8     | 31          | 3,471     | 食品                |
| JULIUS BAER GROUP LTD               |               | 24      | 24    | 93          | 10,431    | 資本市場              |
| SWISS RE LTD                        |               | 38      | 38    | 337         | 37,694    | 保険                |
| TRANSOCEAN LTD                      |               | 34      | —     | —           | —         | エネルギー設備・サービス      |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A       |               | 56      | 61    | 376         | 42,006    | 繊維・アパレル・贅沢品       |
| UBS GROUP AG                        |               | 403     | 423   | 644         | 71,960    | 資本市場              |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 1,789   | 1,903 | 11,842      | 1,322,821 |                   |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 38      | 39    | —           | <3.7%>    |                   |
| (スウェーデン)                            |               |         |       | 千スウェーデンクローナ |           |                   |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB    |               | 160     | 187   | 1,402       | 18,625    | 銀行                |
| SWEDBANK AB                         |               | 101     | 102   | 1,759       | 23,366    | 銀行                |
| SWEDISH MATCH AB                    |               | 23      | 23    | 628         | 8,341     | タバコ               |
| NORDEA BANK AB                      |               | 321     | 359   | 2,715       | 36,066    | 銀行                |
| SECURITAS AB-B SHS                  |               | 28      | 44    | 553         | 7,350     | 商業サービス・用品         |
| INVESTOR AB-B SHS                   |               | 50      | 50    | 1,428       | 18,963    | 各種金融サービス          |
| HENNES&MAURITZ AB-B                 |               | 105     | 109   | 2,972       | 39,473    | 専門小売り             |
| ASSA ABLOY AB-B                     |               | 36      | —     | —           | —         | 建設関連製品            |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A             |               | 53      | —     | —           | —         | 銀行                |
| ERICSSON LM-B                       |               | 334     | 340   | 2,155       | 28,626    | 通信機器              |
| TELIA CO AB                         |               | 291     | 291   | 1,084       | 14,402    | 各種電気通信サービス        |
| SKANSKA AB-B SHS                    |               | 46      | 47    | 835         | 11,097    | 建設・土木             |
| LUNDIN PETROLEUM AB                 |               | 24      | 24    | 342         | 4,554     | 石油・ガス・消耗燃料        |
| ALFA LAVAL AB                       |               | 30      | 30    | 373         | 4,964     | 機械                |
| GETINGE AB-B SHS                    |               | 25      | 25    | 434         | 5,763     | ヘルスケア機器・用品        |
| KINNEVIK INVESTMENT AB-B            |               | 23      | 23    | 512         | 6,805     | 各種金融サービス          |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR |               | 8       | 5     | 258         | 3,429     | 無線通信サービス          |
| ELEKTA AB-B SHS                     |               | 30      | —     | —           | —         | ヘルスケア機器・用品        |
| ICA GRUPPEN AB                      |               | 9       | 9     | 251         | 3,344     | 食品・生活必需品小売り       |
| HUSQVARNA AB-B SHS                  |               | 46      | 46    | 301         | 4,007     | 家庭用耐久財            |
| ELECTROLUX AB-B                     |               | 26      | 26    | 595         | 7,913     | 家庭用耐久財            |

| 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       |
| (スウェーデン)                  |               | 百株      | 百株    | 千スウェーデンクローナ | 千円      |              |
| SKF AB-B SHARES           |               | 41      | 41    | 585         | 7,775   | 機械           |
| ATLAS COPCO AB-A          |               | 73      | —     | —           | —       | 機械           |
| ATLAS COPCO AB-B          |               | 45      | —     | —           | —       | 機械           |
| VOLVO AB-B SHS            |               | 158     | 183   | 1,674       | 22,236  | 機械           |
| SANDVIK AB                |               | 112     | 112   | 885         | 11,765  | 機械           |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS   |               | 20      | 20    | 288         | 3,829   | 各種金融サービス     |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B    |               | 67      | 68    | 1,725       | 22,910  | 家庭用品         |
| BOLIDEN AB                |               | 35      | 24    | 314         | 4,178   | 金属・鉱業        |
| HEXAGON AB-B SHS          |               | 26      | 33    | 1,033       | 13,721  | 電子装置・機器・部品   |
| TELE 2 AB-B SHS           |               | 42      | 42    | 316         | 4,205   | 無線通信サービス     |
| ATLAS COPCO AB-A          |               | —       | 73    | 1,468       | 19,505  | 機械           |
| ATLAS COPCO AB-B          |               | —       | 45    | 837         | 11,115  | 機械           |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A   |               | —       | 175   | 1,820       | 24,169  | 銀行           |
| ASSA ABLOY AB-B           |               | —       | 108   | 1,783       | 23,679  | 建設関連製品       |
| 小 計                       | 株 数 ・ 金 額     | 2,388   | 2,664 | 31,339      | 416,187 |              |
|                           | 銘 柄 数 < 比 率 > | 31      | 30    | —           | <1.2%>  |              |
| (ノルウェー)                   |               |         |       | 千ノルウェークローネ  |         |              |
| DNB ASA                   |               | 104     | 104   | 1,027       | 13,552  | 銀行           |
| TELENOR ASA               |               | 79      | 93    | 1,270       | 16,756  | 各種電気通信サービス   |
| SCHIBSTED ASA             |               | —       | 8     | 190         | 2,518   | メディア         |
| SUBSEA 7 SA               |               | 36      | —     | —           | —       | エネルギー設備・サービス |
| STATOIL ASA               |               | 126     | 132   | 1,767       | 23,313  | 石油・ガス・消耗燃料   |
| YARA INTERNATIONAL ASA    |               | 19      | 19    | 604         | 7,971   | 化学           |
| SEADRILL LTD              |               | 42      | —     | —           | —       | エネルギー設備・サービス |
| NORSK HYDRO               |               | 142     | 142   | 446         | 5,890   | 金属・鉱業        |
| ORKLA ASA                 |               | 94      | 94    | 705         | 9,298   | 食品           |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA |               | 26      | 26    | 355         | 4,684   | 保険           |
| SCHIBSTED ASA-B SHS       |               | —       | 9     | 206         | 2,724   | メディア         |
| 小 計                       | 株 数 ・ 金 額     | 668     | 627   | 6,574       | 86,711  |              |
|                           | 銘 柄 数 < 比 率 > | 9       | 9     | —           | <0.2%>  |              |
| (デンマーク)                   |               |         |       | 千デンマーククローネ  |         |              |
| CARLSBERG B               |               | 11      | 11    | 729         | 12,111  | 飲料           |
| A P MOLLER-MAERSK A/S     |               | 0.78    | 0.78  | 695         | 11,549  | 海運業          |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A |               | 0.5     | 0.5   | 432         | 7,175   | 海運業          |
| DANSKE BANK AS            |               | 75      | 75    | 1,387       | 23,026  | 銀行           |
| GENMAB A/S                |               | —       | 5     | 572         | 9,507   | バイオテクノロジー    |
| TDC A/S                   |               | 82      | 82    | 279         | 4,641   | 各種電気通信サービス   |
| WILLIAM DEMANT HOLDING    |               | 2       | 2     | 179         | 2,978   | ヘルスケア機器・用品   |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S   |               | 22      | 27    | 1,234       | 20,485  | 電気設備         |
| TRYG A/S                  |               | 2       | —     | —           | —       | 保険           |
| DSV A/S                   |               | 18      | 24    | 646         | 10,736  | 陸運・鉄道        |
| PANDORA A/S               |               | 12      | 12    | 1,049       | 17,416  | 繊維・アパレル・贅沢品  |
| CHR HANSEN HOLDING A/S    |               | —       | 10    | 413         | 6,860   | 化学           |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES    |               | 24      | 24    | 783         | 13,003  | 化学           |
| COLOPLAST-B               |               | 12      | 12    | 621         | 10,309  | ヘルスケア機器・用品   |
| NOVO NORDISK A/S-B        |               | 218     | 225   | 8,055       | 133,713 | 医薬品          |
| ISS A/S                   |               | 11      | 19    | 482         | 8,004   | 商業サービス・用品    |

| 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                  |
| (デンマーク)                      |               | 百株      | 百株    | 千デンマーククローネ | 千円      | 保険                      |
| TRYG A/S                     |               | —       | 10    | 123        | 2,045   |                         |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 495     | 544   | 17,684     | 293,566 |                         |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 14      | 16    | —          | <0.8%>  |                         |
| (ユーロ…ドイツ)                    |               |         |       | 千ユーロ       |         |                         |
| ADIDAS AG                    |               | 23      | 24    | 277        | 34,299  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       |               | 39      | 43    | 278        | 34,393  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE |               | 15      | 15    | 67         | 8,355   | インターネットソフトウェア・サービス      |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD       |               | 7       | 7     | 27         | 3,352   | 化学                      |
| HANNOVER RUECK SE            |               | 5       | 7     | 78         | 9,742   | 保険                      |
| GEA GROUP AG                 |               | 18      | 18    | 71         | 8,864   | 機械                      |
| CONTINENTAL AG               |               | 11      | 13    | 242        | 29,952  | 自動車部品                   |
| DEUTSCHE POST AG-REG         |               | 105     | 105   | 270        | 33,405  | 航空貨物・物流サービス             |
| AXEL SPRINGER SE             |               | 3       | 3     | 17         | 2,210   | メディア                    |
| MERCK KGAA                   |               | 13      | 13    | 108        | 13,376  | 医薬品                     |
| RWE AG                       |               | 58      | 58    | 67         | 8,390   | 総合公益事業                  |
| SAP SE                       |               | 101     | 113   | 779        | 96,217  | ソフトウェア                  |
| E.ON SE                      |               | 217     | 217   | 182        | 22,509  | 総合公益事業                  |
| HENKEL AG & CO KGAA          |               | 12      | 13    | 118        | 14,654  | 家庭用品                    |
| METRO AG                     |               | 17      | 17    | 46         | 5,736   | 食品・生活必需品小売り             |
| BAYER AG-REG                 |               | 89      | 95    | 949        | 117,256 | 医薬品                     |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   |               | 19      | 21    | 217        | 26,862  | 家庭用品                    |
| BASF SE                      |               | 99      | 103   | 708        | 87,484  | 化学                      |
| CELESIO AG                   |               | 9       | —     | —          | —       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| BEIERSDORF AG                |               | 10      | 10    | 81         | 10,026  | パーソナル用品                 |
| HEIDELBERGCEMENT AG          |               | 14      | 14    | 112        | 13,902  | 建設資材                    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE       |               | 23      | 23    | 178        | 22,104  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE-REG               |               | 50      | 52    | 742        | 91,696  | 保険                      |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       |               | 18      | 34    | 42         | 5,244   | 旅客航空輸送業                 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   |               | 19      | 18    | 305        | 37,698  | 保険                      |
| VOLKSWAGEN AG                |               | 3       | 3     | 49         | 6,131   | 自動車                     |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           |               | 18      | 20    | 256        | 31,646  | 自動車                     |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES |               | 103     | 111   | 664        | 82,021  | 自動車                     |
| MAN SE                       |               | 4       | 4     | 40         | 5,052   | 機械                      |
| THYSSENKRUPP AG              |               | 47      | 35    | 65         | 8,071   | 金属・鉱業                   |
| SIEMENS AG                   |               | 87      | 91    | 848        | 104,773 | コングロマリット                |
| QIAGEN NV                    |               | 22      | 22    | 43         | 5,375   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| LINDE AG                     |               | 20      | 21    | 265        | 32,831  | 化学                      |
| DEUTSCHE BANK AG-REG         |               | 147     | 160   | 234        | 28,946  | 資本市場                    |
| BAYER MOTOREN WERK           |               | 36      | 36    | 277        | 34,301  | 自動車                     |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD |               | 7       | 7     | 49         | 6,130   | 自動車                     |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG         |               | 349     | 374   | 577        | 71,286  | 各種電気通信サービス              |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     |               | 126     | 126   | 152        | 18,811  | 半導体・半導体製造装置             |
| DEUTSCHE BOERSE AG           |               | 20      | 20    | 155        | 19,155  | 各種金融サービス                |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE |               | 16      | 16    | 76         | 9,414   | 自動車                     |
| FRAPORT AG                   |               | 3       | 3     | 19         | 2,349   | 運送インフラ                  |
| LANXESS                      |               | 9       | 9     | 42         | 5,284   | 化学                      |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR        |               | 32      | 33    | 90         | 11,145  | 不動産管理・開発                |
| SYMRISE AG                   |               | 15      | 15    | 87         | 10,777  | 化学                      |

| 銘<br>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…ドイツ)                         |  | 百株        | 百株    | 千ユーロ  | 千円     |                    |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG      |  | 2         | —     | —     | —      | メディア               |
| BRENNTAG AG                       |  | 19        | 19    | 91    | 11,352 | 商社・流通業             |
| K+S AG                            |  | 16        | 24    | 52    | 6,529  | 化学                 |
| EVONIK INDUSTRIES AG              |  | —         | 18    | 51    | 6,411  | 化学                 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG |  | 54        | 110   | 49    | 6,171  | 各種電気通信サービス         |
| HUGO BOSS AG                      |  | 7         | 7     | 39    | 4,817  | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| COMMERZBANK AG                    |  | 101       | 123   | 86    | 10,630 | 銀行                 |
| OSRAM LICHT AG                    |  | 8         | 8     | 37    | 4,591  | 電気設備               |
| VONOVIA SE                        |  | 40        | 52    | 157   | 19,469 | 不動産管理・開発           |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE          |  | 22        | 27    | 119   | 14,725 | メディア               |
| ZALANDO SE                        |  | —         | 9     | 25    | 3,152  | インターネット販売・カタログ販売   |
| 小 計                               |  | 株 数 ・ 金 額 | 2,349 | 2,553 | 10,681 | 1,319,098          |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                     |  | 53        | 53    | —     | <3.7%> |                    |
| (ユーロ…イタリア)                        |  |           |       |       |        |                    |
| ASSICURAZIONI GENERALI            |  | 130       | 130   | 168   | 20,757 | 保険                 |
| INTESA SANPAOLO                   |  | 1,420     | 1,450 | 324   | 40,109 | 銀行                 |
| INTESA SANPAOLO-RSP               |  | 140       | 140   | 30    | 3,723  | 銀行                 |
| MEDIOBANCA S.P.A.                 |  | 56        | 56    | 34    | 4,318  | 資本市場               |
| PIRELLI&CO                        |  | 29        | —     | —     | —      | 自動車部品              |
| SAIPEM SPA                        |  | 32        | 736   | 27    | 3,391  | エネルギー設備・サービス       |
| LUXOTTICA GROUP SPA               |  | 17        | 17    | 83    | 10,366 | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| ENEL SPA                          |  | 737       | 890   | 346   | 42,753 | 電力                 |
| ENI SPA                           |  | 278       | 297   | 397   | 49,073 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| SNAM SPA                          |  | 205       | 250   | 133   | 16,439 | ガス                 |
| TENARIS SA                        |  | 56        | 56    | 62    | 7,696  | エネルギー設備・サービス       |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA    |  | 88        | 88    | 27    | 3,455  | 銀行                 |
| TELECOM ITALIA SPA                |  | 1,030     | 1,430 | 121   | 15,010 | 各種電気通信サービス         |
| TELECOM ITALIA-RNC                |  | 680       | 680   | 46    | 5,764  | 各種電気通信サービス         |
| ATLANTIA SPA                      |  | 43        | 43    | 103   | 12,760 | 運送インフラ             |
| TERNA SPA                         |  | 163       | 163   | 79    | 9,859  | 電力                 |
| EXOR SPA                          |  | 13        | 13    | 41    | 5,108  | 各種金融サービス           |
| LEONARDO-FINMECCANICA SPA         |  | 42        | 42    | 43    | 5,321  | 航空宇宙・防衛            |
| PRYSMIAN SPA                      |  | 16        | 27    | 55    | 6,805  | 電気設備               |
| ENEL GREEN POWER SPA              |  | 190       | —     | —     | —      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| UNICREDIT SPA                     |  | 474       | 530   | 158   | 19,582 | 銀行                 |
| UNIPOLSAI SPA                     |  | 80        | 80    | 15    | 1,919  | 保険                 |
| FERRARI NV                        |  | —         | 17    | 64    | 7,916  | 自動車                |
| CNH INDUSTRIAL NV                 |  | 103       | 103   | 61    | 7,644  | 機械                 |
| BANCO POPOLARE SPA                |  | 33        | 33    | 16    | 2,035  | 銀行                 |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA      |  | 582       | —     | —     | —      | 銀行                 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV      |  | 106       | 87    | 57    | 7,106  | 自動車                |
| 小 計                               |  | 株 数 ・ 金 額 | 6,743 | 7,358 | 2,501  | 308,921            |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                     |  | 26        | 24    | —     | <0.9%> |                    |
| (ユーロ…フランス)                        |  |           |       |       |        |                    |
| BOUYGUES                          |  | 16        | 21    | 61    | 7,538  | 建設・土木              |
| AIRBUS GROUP SE                   |  | 64        | 67    | 364   | 44,993 | 航空宇宙・防衛            |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT              |  | 51        | 51    | 102   | 12,677 | 総合公益事業             |
| LOREAL-ORD                        |  | 27        | 29    | 469   | 58,018 | パーソナル用品            |

| 銘柄                                  | 株数  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等          |
|-------------------------------------|-----|---------|-------|---------|----------------|
|                                     |     | 株数      | 評 価 額 |         |                |
|                                     |     |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                |
| (ユーロ…フランス)                          | 百株  | 百株      | 千ユーロ  | 千円      |                |
| CHRISTIAN DIOR SE                   | 5   | 5       | 85    | 10,504  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 30  | 31      | 459   | 56,797  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| THALES SA                           | 10  | 10      | 81    | 10,067  | 航空宇宙・防衛        |
| CAP GEMINI SA                       | 16  | 20      | 162   | 20,037  | 情報技術サービス       |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA        | 7   | 7       | 34    | 4,293   | 食品・生活必需品小売り    |
| INGENICO GROUP                      | —   | 6       | 70    | 8,738   | 電子装置・機器・部品     |
| PUBLICIS GROUPE                     | 19  | 19      | 126   | 15,624  | メディア           |
| LAFARGE SA                          | 19  | —       | —     | —       | 建設資材           |
| LAGARDERE S. C. A                   | 18  | 9       | 21    | 2,617   | メディア           |
| BOLLORE                             | 75  | 75      | 25    | 3,098   | 航空貨物・物流サービス    |
| MICHELIN (CGDE)                     | 21  | 22      | 203   | 25,095  | 自動車部品          |
| PERNOD RICARD SA                    | 23  | 23      | 227   | 28,033  | 飲料             |
| RENAULT SA                          | 22  | 21      | 174   | 21,606  | 自動車            |
| REMY COINTREAU                      | 3   | 3       | 24    | 3,073   | 飲料             |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 57  | 65      | 349   | 43,216  | 電気設備           |
| VIVENDI SA                          | 132 | 129     | 218   | 26,985  | メディア           |
| TECHNIP SA                          | 12  | 12      | 56    | 7,025   | エネルギー設備・サービス   |
| VALEO SA                            | 7   | 9       | 134   | 16,663  | 自動車部品          |
| ORANGE SA                           | 209 | 227     | 330   | 40,800  | 各種電気通信サービス     |
| HERMES INTERNATIONAL                | 2   | 2       | 82    | 10,224  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| SOCIETE BIC SA                      | 3   | 3       | 37    | 4,653   | 商業サービス・用品      |
| DASSAULT SYSTEMES SA                | 14  | 14      | 96    | 11,932  | ソフトウェア         |
| KERING SA                           | 8   | 8       | 119   | 14,733  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| CNP ASSURANCES                      | 16  | 16      | 23    | 2,865   | 保険             |
| CARREFOUR SUPERMARCHE               | 58  | 58      | 140   | 17,403  | 食品・生活必需品小売り    |
| ATOS SE                             | 9   | 9       | 73    | 9,083   | 情報技術サービス       |
| SANOFI                              | 128 | 134     | 968   | 119,626 | 医薬品            |
| ACCOR SA                            | 21  | 21      | 82    | 10,183  | ホテル・レストラン・レジャー |
| STMICROELECTRONICS NV               | 55  | 55      | 25    | 3,196   | 半導体・半導体製造装置    |
| SOCIETE GENERALE                    | 79  | 80      | 263   | 32,532  | 銀行             |
| ALCATEL-LUCENT                      | 289 | —       | —     | —       | 通信機器           |
| EURAZEO                             | 6   | 2       | 17    | 2,211   | 各種金融サービス       |
| SODEXO                              | 10  | 10      | 94    | 11,671  | ホテル・レストラン・レジャー |
| AXA                                 | 193 | 229     | 473   | 58,453  | 保険             |
| PEUGEOT CITROEN                     | 38  | 52      | 69    | 8,585   | 自動車            |
| JC DECAUX SA                        | 7   | 7       | 29    | 3,644   | メディア           |
| ESSILOR INTERNATIONAL               | 22  | 22      | 262   | 32,379  | ヘルスケア機器・用品     |
| CREDIT AGRICOLE SA                  | 116 | 116     | 104   | 12,910  | 銀行             |
| ZODIAC AEROSPACE                    | 18  | 18      | 36    | 4,479   | 航空宇宙・防衛        |
| BNP PARIBAS                         | 117 | 123     | 543   | 67,060  | 銀行             |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)          | 48  | 55      | 210   | 26,053  | 建設関連製品         |
| WENDEL                              | 2   | 2       | 27    | 3,334   | 各種金融サービス       |
| ILIAD SA                            | 3   | 3       | 60    | 7,438   | 各種電気通信サービス     |
| SES FDR                             | 31  | 39      | 94    | 11,654  | メディア           |
| IMERYS                              | 4   | 4       | 28    | 3,458   | 建設資材           |
| SAFRAN SA                           | 31  | 37      | 220   | 27,173  | 航空宇宙・防衛        |
| ENGIE                               | 158 | 158     | 210   | 25,950  | 総合公益事業         |
| ALSTOM                              | 27  | 19      | 41    | 5,082   | 機械             |

| 銘<br>柄                      |  | 期首(前期末)   | 当 期 末 |       | 業 種 等   |              |
|-----------------------------|--|-----------|-------|-------|---------|--------------|
|                             |  | 株 数       | 株 数   | 評 価 額 |         |              |
|                             |  |           |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額       |
| (ユーロ…フランス)                  |  | 百株        | 百株    | 千ユーロ  | 千円      |              |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS     |  | 14        | 22    | 59    | 7,392   | メディア         |
| ELECTRICITE DE FRANCE       |  | 22        | 22    | 25    | 3,201   | 電力           |
| ARKEMA                      |  | 8         | 8     | 56    | 6,924   | 化学           |
| LEGRAND SA                  |  | 27        | 33    | 161   | 19,972  | 電気設備         |
| TOTAL SA                    |  | 231       | 252   | 1,060 | 130,950 | 石油・ガス・消耗燃料   |
| ADP                         |  | 2         | 2     | 31    | 3,856   | 運送インフラ       |
| VALLOUREC                   |  | 14        | —     | —     | —       | エネルギー設備・サービス |
| NATIXIS                     |  | 110       | 110   | 48    | 5,957   | 銀行           |
| SCOR SE                     |  | 14        | 14    | 43    | 5,421   | 保険           |
| REXEL SA                    |  | 37        | 37    | 47    | 5,918   | 商社・流通業       |
| VINCI                       |  | 51        | 56    | 359   | 44,361  | 建設・土木        |
| DANONE                      |  | 61        | 67    | 409   | 50,511  | 食品           |
| AIR LIQUIDE                 |  | 36        | 39    | 373   | 46,123  | 化学           |
| BUREAU VERITAS SA           |  | 31        | 31    | 63    | 7,857   | 専門サービス       |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR |  | 43        | 65    | 72    | 8,945   | 運送インフラ       |
| SUEZ ENVIRONNEMENT SA       |  | 36        | 36    | 58    | 7,179   | 総合公益事業       |
| EDENRED                     |  | 27        | 18    | 31    | 3,831   | 商業サービス・用品    |
| NUMERICABLE-SFR             |  | 12        | 12    | 32    | 4,069   | メディア         |
| 小 計                         |  | 株 数 ・ 金 額 | 3,155 | 3,001 | 11,158  | 1,377,963    |
| 銘 柄 数 < 比 率 >               |  |           | 69    | 67    | —       | <3.8%>       |
| (ユーロ…オランダ)                  |  |           |       |       |         |              |
| RELX NV                     |  | 74        | 113   | 169   | 20,934  | メディア         |
| RANDSTAD HOLDING NV         |  | 12        | 16    | 75    | 9,349   | 専門サービス       |
| AKZO NOBEL                  |  | 26        | 26    | 159   | 19,749  | 化学           |
| WOLTERS KLUWER              |  | 31        | 31    | 104   | 12,889  | メディア         |
| VOPAK                       |  | 7         | 7     | 32    | 3,982   | 石油・ガス・消耗燃料   |
| AEGON NV                    |  | 196       | 196   | 94    | 11,688  | 保険           |
| KONINKLIJKE KPN NV          |  | 328       | 328   | 111   | 13,808  | 各種電気通信サービス   |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV      |  | 107       | 110   | 255   | 31,514  | コングロマリット     |
| ING GROEP NV                |  | 423       | 425   | 433   | 53,532  | 銀行           |
| HEINEKEN NV                 |  | 27        | 25    | 207   | 25,584  | 飲料           |
| ARCELORMITTAL               |  | 105       | 178   | 72    | 8,982   | 金属・鉱業        |
| HEINEKEN HOLDING NV         |  | 11        | 11    | 80    | 9,916   | 飲料           |
| KONINKLIJKE DSM NV          |  | 19        | 19    | 98    | 12,116  | 化学           |
| UNILEVER NV-CVA             |  | 180       | 188   | 737   | 91,076  | パーソナル用品      |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA    |  | 12        | 12    | 42    | 5,294   | 建設・土木        |
| TNT EXPRESS NV              |  | 35        | 70    | 55    | 6,898   | 航空貨物・物流サービス  |
| DELTA LLOYD NV              |  | 23        | —     | —     | —       | 保険           |
| ASML HOLDING NV             |  | 39        | 40    | 330   | 40,836  | 半導体・半導体製造装置  |
| GEMALTO                     |  | 8         | 8     | 44    | 5,547   | ソフトウェア       |
| OCI                         |  | 9         | 9     | 13    | 1,623   | 化学           |
| KONINKLIJKE AHOLD NV        |  | 101       | 96    | 184   | 22,826  | 食品・生活必需品小売り  |
| NN GROUP NV                 |  | 13        | 40    | 117   | 14,522  | 保険           |
| ALTICE NV - B               |  | —         | 9     | 11    | 1,450   | メディア         |
| ALTICE NV - A               |  | —         | 49    | 63    | 7,836   | メディア         |
| 小 計                         |  | 株 数 ・ 金 額 | 1,786 | 2,008 | 3,497   | 431,960      |
| 銘 柄 数 < 比 率 >               |  |           | 22    | 23    | —       | <1.2%>       |

| 銘<br>柄                                  |                  | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |             | 業<br>種<br>等 |             |
|-----------------------------------------|------------------|---------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|                                         |                  | 株<br>数  | 株<br>数      | 評<br>価<br>額 |             |             |
|                                         |                  |         |             | 外貨建金額       |             | 邦貨換算金額      |
| (ユーロ…スペイン)                              |                  | 百株      | 百株          | 千ユーロ        | 千円          |             |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA             |                  | 44      | 64          | 92          | 11,396      | 運送インフラ      |
| ENDESA S. A.                            |                  | 35      | 35          | 64          | 7,937       | 電力          |
| BANKINTER S. A.                         |                  | 82      | 82          | 51          | 6,413       | 銀行          |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A.   |                  | 698     | 712         | 393         | 48,606      | 銀行          |
| GAS NATURAL SDG                         |                  | 43      | 44          | 78          | 9,674       | ガス          |
| REPSOL SA                               |                  | 109     | 117         | 129         | 16,042      | 石油・ガス・消耗燃料  |
| BANCO SANTANDER SA                      |                  | 1,552   | 1,670       | 661         | 81,687      | 銀行          |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA            |                  | 11      | 11          | 86          | 10,633      | 電力          |
| TELEFONICA SA                           |                  | 495     | 524         | 480         | 59,389      | 各種電気通信サービス  |
| ZARDOYA OTIS S. A                       |                  | 16      | 17          | 15          | 1,969       | 機械          |
| ENAGAS                                  |                  | 20      | 19          | 50          | 6,256       | ガス          |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV            |                  | 21      | 21          | 60          | 7,477       | 建設・土木       |
| GRIFOLS SA                              |                  | 18      | —           | —           | —           | バイオテクノロジー   |
| FERROVIAL SA                            |                  | 44      | 59          | 107         | 13,242      | 建設・土木       |
| FERROVIAL SA-RIGHTS                     |                  | 44      | —           | —           | —           | 建設・土木       |
| MAPFRE SA                               |                  | 127     | 127         | 27          | 3,395       | 保険          |
| BANCO DE SABADELL SA                    |                  | 489     | 520         | 79          | 9,832       | 銀行          |
| CAIXABANK                               |                  | 228     | 314         | 74          | 9,240       | 銀行          |
| IBERDROLA SA                            |                  | 580     | 630         | 384         | 47,441      | 電力          |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS             |                  | 49      | 49          | 197         | 24,394      | 情報技術サービス    |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP |                  | 79      | 100         | 64          | 8,019       | 旅客航空輸送業     |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL             |                  | 54      | 54          | 26          | 3,216       | 食品・生活必需品小売り |
| BANKIA SA                               |                  | 490     | 490         | 37          | 4,671       | 銀行          |
| BCO POPULAR ESPANOL                     |                  | 180     | 185         | 38          | 4,710       | 銀行          |
| BCO POPULAR ESPANOL - RTS               |                  | 178     | —           | —           | —           | 銀行          |
| INDITEX SA                              |                  | 117     | 128         | 360         | 44,527      | 専門小売り       |
| AENA SA                                 |                  | 6       | 6           | 82          | 10,185      | 運送インフラ      |
| GRIFOLS SA                              |                  | —       | 36          | 66          | 8,215       | バイオテクノロジー   |
| 小計                                      | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 5,815   | 6,017       | 3,713       | 458,576     |             |
| (ユーロ…ベルギー)                              |                  |         |             |             |             |             |
| UMICORE                                 |                  | 8       | 8           | 35          | 4,436       | 化学          |
| DELHAIZE GROUP                          |                  | 11      | 11          | 106         | 13,096      | 食品・生活必需品小売り |
| KBC GROEP NV                            |                  | 28      | 26          | 119         | 14,708      | 銀行          |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV                 |                  | 86      | 92          | 1,022       | 126,291     | 飲料          |
| SOLVAY SA                               |                  | 5       | 9           | 79          | 9,877       | 化学          |
| UCB SA                                  |                  | 13      | 13          | 85          | 10,609      | 医薬品         |
| COLRUYT SA                              |                  | 9       | 9           | 47          | 5,874       | 食品・生活必需品小売り |
| GROUPE BRUXELLES LAM                    |                  | 10      | 10          | 73          | 9,125       | 各種金融サービス    |
| PROXIMUS                                |                  | 15      | 15          | 43          | 5,384       | 各種電気通信サービス  |
| TELENET GROUP HOLDING NV                |                  | 6       | 6           | 29          | 3,636       | メディア        |
| AGEAS                                   |                  | 25      | 26          | 83          | 10,367      | 保険          |
| 小計                                      | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 220     | 227         | 1,728       | 213,408     |             |
| (ユーロ…オーストリア)                            |                  |         |             |             |             |             |
| OMV AG                                  |                  | 20      | 21          | 51          | 6,391       | 石油・ガス・消耗燃料  |
| VOESTALPINE AG                          |                  | 12      | 12          | 34          | 4,260       | 金属・鉱業       |
| ERSTE GROUP BANK AG                     |                  | 32      | 32          | 75          | 9,290       | 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    |                |
| (ユーロ…オーストリア)                     |              | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                |
| IMMOFINANZ AG                    |              | 87      | —      | —      | —         | 不動産管理・開発       |
| IMMOEAST AG-RIGHTS               |              | 83      | 83     | —      | —         | 不動産管理・開発       |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG |              | 15      | 15     | 20     | 2,480     | 銀行             |
| VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN   |              | 3       | —      | —      | —         | 保険             |
| ANDRITZ AG                       |              | 7       | 7      | 31     | 3,925     | 機械             |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 259     | 170    | 213    | 26,348    |                |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 8       | 6      | —      | <0.1%>    |                |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)                    |              |         |        |        |           |                |
| RTL GROUP                        |              | 3       | 3      | 22     | 2,827     | メディア           |
| ALTICE SA                        |              | 9       | —      | —      | —         | メディア           |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 12      | 3      | 22     | 2,827     |                |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 2       | 1      | —      | <0.0%>    |                |
| (ユーロ…フィンランド)                     |              |         |        |        |           |                |
| WARTSILA OYJ                     |              | 16      | 16     | 58     | 7,209     | 機械             |
| UPM-KYMMENE OYJ                  |              | 57      | 57     | 94     | 11,663    | 紙製品・林産品        |
| STORA ENSO OYJ-R                 |              | 54      | 54     | 38     | 4,784     | 紙製品・林産品        |
| SAMPO OYJ-A SHS                  |              | 49      | 49     | 191    | 23,635    | 保険             |
| FORTUM OYJ                       |              | 51      | 51     | 64     | 8,004     | 電力             |
| ELISA CORPORATION                |              | 16      | 16     | 51     | 6,378     | 各種電気通信サービス     |
| METSO OYJ                        |              | 15      | 15     | 29     | 3,697     | 機械             |
| NOKIA OYJ                        |              | 423     | 660    | 330    | 40,833    | 通信機器           |
| NESTE OYJ                        |              | 10      | 19     | 52     | 6,522     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| NOKIAN RENKAAT OYJ               |              | 11      | 11     | 34     | 4,288     | 自動車部品          |
| KONE OYJ                         |              | 36      | 39     | 151    | 18,700    | 機械             |
| ORION OYJ                        |              | 10      | 10     | 30     | 3,751     | 医薬品            |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 748     | 997    | 1,129  | 139,470   |                |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 12      | 12     | —      | <0.4%>    |                |
| (ユーロ…アイルランド)                     |              |         |        |        |           |                |
| BANK OF IRELAND                  |              | 3,080   | 3,080  | 71     | 8,862     | 銀行             |
| CRH PLC                          |              | 93      | 98     | 248    | 30,648    | 建設資材           |
| KERRY GROUP PLC-A                |              | 19      | 19     | 152    | 18,770    | 食品             |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD   |              | 134     | 134    | —      | —         | 銀行             |
| PADDY POWER PLC                  |              | —       | 9      | 110    | 13,591    | ホテル・レストラン・レジャー |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 3,326   | 3,340  | 582    | 71,872    |                |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 4       | 5      | —      | <0.2%>    |                |
| (ユーロ…ポルトガル)                      |              |         |        |        |           |                |
| ENERGIAS DE PORTUGAL             |              | 283     | 238    | 75     | 9,310     | 電力             |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD   |              | 4,820   | 4,820  | 16     | 2,011     | 銀行             |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS      |              | 38      | 58     | 67     | 8,344     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| JERONIMO MARTINS                 |              | 22      | 36     | 50     | 6,192     | 食品・生活必需品小売り    |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 5,163   | 5,152  | 209    | 25,859    |                |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 4       | 4      | —      | <0.1%>    |                |
| ユ ー ロ 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 29,580  | 30,830 | 35,438 | 4,376,309 |                |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 238     | 231    | —      | <12.1%>   |                |
| (香港)                             |              |         |        | 千香港ドル  |           |                |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY           |              | 32      | 32     | 176    | 2,463     | 半導体・半導体製造装置    |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD         |              | 220     | 220    | 317    | 4,431     | 不動産管理・開発       |
| BANK OF EAST ASIA                |              | 115     | 115    | 326    | 4,562     | 銀行             |

| 銘<br>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         |
| (香港)                               |               | 百株      | 百株     | 千香港ドル     | 千円      |                |
| CLP HLDGS                          |               | 205     | 205    | 1,493     | 20,863  | 電力             |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS             |               | 80      | 170    | 205       | 2,873   | 旅客航空輸送業        |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE         |               | 60      | 80     | 595       | 8,320   | 電力             |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD |               | 124     | 126    | 2,327     | 32,511  | 各種金融サービス       |
| LI & FUNG LTD                      |               | 620     | 620    | 273       | 3,819   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| MTR CORP                           |               | 140     | 190    | 731       | 10,219  | 陸運・鉄道          |
| FIRST PACIFIC CO                   |               | 320     | 320    | 155       | 2,172   | 各種金融サービス       |
| HANG SENG BANK                     |               | 88      | 90     | 1,240     | 17,325  | 銀行             |
| HENDERSON LAND                     |               | 99      | 149    | 698       | 9,764   | 不動産管理・開発       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD          |               | 150     | 150    | 1,146     | 16,020  | 電力             |
| WHARF (HOLDING)                    |               | 162     | 172    | 718       | 10,043  | 不動産管理・開発       |
| HONG KONG & CHINA GAS              |               | 671     | 738    | 1,073     | 15,003  | ガス             |
| HUTCHISON WHAMPOA                  |               | 240     | —      | —         | —       | コングロマリット       |
| HYSAN DEVELOPMENT                  |               | 70      | 70     | 226       | 3,168   | 不動産管理・開発       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L       |               | 230     | 310    | 764       | 10,675  | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY PROPERTIES                   |               | 65      | 65     | 130       | 1,825   | 不動産管理・開発       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         |               | 415     | 415    | 915       | 12,783  | 銀行             |
| NWS HOLDINGS LTD                   |               | 190     | 190    | 224       | 3,132   | コングロマリット       |
| PCCW LTD                           |               | 410     | 410    | 209       | 2,932   | 各種電気通信サービス     |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG           |               | 105     | 55     | 155       | 2,178   | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEW WORLD DEVELOPMENT              |               | 473     | 663    | 482       | 6,736   | 不動産管理・開発       |
| SHANGRI-LA ASIA LTD                |               | 190     | 190    | 169       | 2,364   | ホテル・レストラン・レジャー |
| SINO LAND CO.LTD                   |               | 310     | 310    | 360       | 5,040   | 不動産管理・開発       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES            |               | 190     | 200    | 1,851     | 25,858  | 不動産管理・開発       |
| SWIRE PACIFIC-A                    |               | 70      | 70     | 578       | 8,077   | 不動産管理・開発       |
| WHEELOCK & COMPANY LTD             |               | 80      | 80     | 279       | 3,906   | 不動産管理・開発       |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO           |               | 130     | 130    | 384       | 5,375   | 家庭用耐久財         |
| SJM HOLDINGS LIMITED               |               | 240     | 240    | 116       | 1,622   | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN MACAU LTD                     |               | 180     | 180    | 194       | 2,720   | ホテル・レストラン・レジャー |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD             |               | 136     | 136    | 140       | 1,960   | ホテル・レストラン・レジャー |
| AIA GROUP LTD                      |               | 1,332   | 1,390  | 6,192     | 86,508  | 保険             |
| HKT TRUST AND HKT LTD              |               | 211     | 381    | 420       | 5,868   | 各種電気通信サービス     |
| SANDS CHINA LTD                    |               | 280     | 280    | 761       | 10,639  | ホテル・レストラン・レジャー |
| SWIRE PROPERTIES LTD               |               | 108     | 108    | 217       | 3,032   | 不動産管理・開発       |
| WH GROUP LIMITED                   |               | 320     | 620    | 367       | 5,127   | 食品             |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD          |               | 160     | 304    | 2,815     | 39,325  | コングロマリット       |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING       |               | —       | 294    | 1,429     | 19,971  | 不動産管理・開発       |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額     | 9,223   | 10,470 | 30,868    | 431,229 |                |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 39      | 39     | —         | <1.2%>  |                |
| (シンガポール)                           |               |         |        | 千シンガポールドル |         |                |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING         |               | 180     | 180    | 57        | 4,569   | 航空宇宙・防衛        |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD          |               | 860     | 860    | 32        | 2,584   | 食品             |
| DBS GROUP HLDGS                    |               | 185     | 212    | 316       | 24,996  | 銀行             |
| CITY DEVELOPMENTS LTD              |               | 40      | 40     | 32        | 2,559   | 不動産管理・開発       |
| SEMBORP MARINE                     |               | 118     | 118    | 18        | 1,474   | 機械             |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD         |               | 10      | 11     | 39        | 3,132   | 販売             |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD             |               | 70      | 120    | 89        | 7,107   | 各種金融サービス       |
| CAPITALAND LIMITED                 |               | 275     | 275    | 81        | 6,480   | 不動産管理・開発       |

| 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      |                         |
| GENTING SINGAPORE PLC                |               | 696     | 696   | 53        | 4,210   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| COMFORTDELGRO CORP LTD               |               | 180     | 300   | 83        | 6,595   | 陸運・鉄道                   |
| SINGAPORE AIRLINES LTD               |               | 68      | 68    | 77        | 6,103   | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED OVERSEAS BANK                 |               | 139     | 139   | 248       | 19,653  | 銀行                      |
| UOL GROUP LIMITED                    |               | 30      | 30    | 17        | 1,354   | 不動産管理・開発                |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS             |               | 170     | 170   | 66        | 5,296   | メディア                    |
| NOBLE GROUP LTD                      |               | 448     | 448   | 15        | 1,240   | 商社・流通業                  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED |               | 890     | 900   | 350       | 27,685  | 各種電気通信サービス              |
| SEMCORP INDUSTRIES                   |               | 120     | 120   | 32        | 2,581   | コングロマリット                |
| OCBC-ORD                             |               | 332     | 352   | 297       | 23,499  | 銀行                      |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD             |               | 180     | 180   | 62        | 4,967   | 食品                      |
| STARHUB LTD                          |               | 80      | 80    | 27        | 2,138   | 無線通信サービス                |
| KEPPEL CORP.                         |               | 150     | 150   | 78        | 6,227   | コングロマリット                |
| YANGZIJANG SHIPBUILDING              |               | 270     | 270   | 24        | 1,910   | 機械                      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L         |               | 340     | 340   | 61        | 4,839   | 不動産管理・開発                |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 5,831   | 6,059 | 2,165     | 171,209 |                         |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 23      | 23    | —         | <0.5%>  |                         |
| (オーストラリア)                            |               |         |       | 千豪ドル      |         |                         |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD               |               | 16      | 16    | 111       | 8,844   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK         |               | 296     | 337   | 821       | 65,071  | 銀行                      |
| AMCOR                                |               | 135     | 135   | 214       | 16,978  | 容器・包装                   |
| WESTPAC BANKING CORP                 |               | 334     | 383   | 1,191     | 94,367  | 銀行                      |
| BANK OF QUEENSLAND LTD               |               | 41      | 41    | 46        | 3,699   | 銀行                      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           |               | 212     | 212   | 64        | 5,104   | 金属・鉱業                   |
| TELSTRA CORP LTD                     |               | 459     | 459   | 258       | 20,466  | 各種電気通信サービス              |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD        |               | 40      | 40    | 38        | 3,009   | 銀行                      |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 |               | 48      | 48    | 41        | 3,322   | 飲料                      |
| ASX LTD                              |               | 20      | 20    | 89        | 7,072   | 各種金融サービス                |
| BHP BILLITON LIMITED                 |               | 346     | 374   | 688       | 54,531  | 金属・鉱業                   |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED             |               | 30      | 30    | 100       | 7,933   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD           |               | 55      | 55    | 26        | 2,079   | 複合小売り                   |
| COMPUTERSHARE LTD                    |               | 41      | 41    | 42        | 3,338   | 情報技術サービス                |
| CSL LIMITED                          |               | 50      | 52    | 572       | 45,302  | バイオテクノロジー               |
| REA GROUP LTD                        |               | 6       | 6     | 32        | 2,564   | メディア                    |
| TRANSURBAN GROUP                     |               | 186     | 230   | 284       | 22,533  | 運送インフラ                  |
| COCHLEAR LTD                         |               | 7       | 7     | 79        | 6,258   | ヘルスケア機器・用品              |
| ORIGIN ENERGY LTD                    |               | 127     | 230   | 119       | 9,472   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA       |               | 178     | 196   | 1,485     | 117,634 | 銀行                      |
| BORAL LTD                            |               | 90      | 90    | 59        | 4,747   | 建設資材                    |
| RIO TINTO LTD                        |               | 47      | 47    | 219       | 17,398  | 金属・鉱業                   |
| APA GROUP                            |               | 121     | 121   | 110       | 8,782   | ガス                      |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD               |               | —       | 57    | 58        | 4,595   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD        |               | 274     | 300   | 180       | 14,256  | 保険                      |
| TPG TELECOM LTD                      |               | 40      | 40    | 44        | 3,560   | 各種電気通信サービス              |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD       |               | 8       | 8     | 31        | 2,469   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ORICA LTD                            |               | 33      | 33    | 44        | 3,536   | 化学                      |
| WORLEYPARSONS LTD                    |               | 32      | —     | —         | —       | エネルギー設備・サービス            |
| SUNCORP GROUP LTD                    |               | 139     | 139   | 177       | 14,080  | 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                  |
| (オーストラリア)                   |  | 百株        | 百株    | 千豪ドル        | 千円       |                         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK     |  | 262       | 304   | 864         | 68,498   | 銀行                      |
| NEWCREST MINING             |  | 76        | 96    | 193         | 15,320   | 金属・鉱業                   |
| OIL SEARCH LTD              |  | —         | 140   | 95          | 7,595    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INCITEC PIVOT LTD           |  | 170       | 170   | 48          | 3,850    | 化学                      |
| TOLL HLDGS                  |  | 59        | —     | —           | —        | 航空貨物・物流サービス             |
| AMP LIMITED                 |  | 317       | 317   | 186         | 14,737   | 保険                      |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED      |  | 55        | 52    | 17          | 1,379    | 旅客航空輸送業                 |
| QBE INSURANCE               |  | 151       | 151   | 172         | 13,657   | 保険                      |
| CHALLENGER LIMITED          |  | —         | 60    | 55          | 4,414    | 各種金融サービス                |
| SANTOS LTD.                 |  | 100       | 230   | 96          | 7,614    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SONIC HEALTHCARE LTD        |  | 46        | 46    | 93          | 7,392    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TABCORP HOLDINGS            |  | 64        | 64    | 27          | 2,144    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESFARMERS LIMITED          |  | 123       | 126   | 543         | 43,070   | 食品・生活必需品小売り             |
| ALUMINA LTD                 |  | 262       | 262   | 36          | 2,873    | 金属・鉱業                   |
| ILUKA RESOURCES LTD         |  | 58        | 58    | 35          | 2,834    | 金属・鉱業                   |
| WOODSIDE PETROLEUM          |  | 80        | 80    | 218         | 17,322   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WOOLWORTHS LIMITED          |  | 138       | 138   | 296         | 23,520   | 食品・生活必需品小売り             |
| DUET GROUP                  |  | —         | 240   | 55          | 4,390    | 総合公益事業                  |
| SEEK LTD                    |  | 38        | 38    | 65          | 5,164    | 専門サービス                  |
| TATTS GROUP LTD             |  | 149       | 149   | 58          | 4,661    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BRAMBLES LTD                |  | 161       | 193   | 252         | 20,008   | 商業サービス・用品               |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT   |  | 26        | 26    | 15          | 1,233    | 資本市場                    |
| ASCIANO LTD                 |  | 105       | 51    | 45          | 3,598    | 陸運・鉄道                   |
| MACQUARIE GROUP LIMITED     |  | 33        | 34    | 227         | 18,041   | 資本市場                    |
| CROWN RESORTS LTD           |  | 48        | 48    | 59          | 4,691    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| VOCUS COMMUNICATIONS LTD    |  | —         | 60    | 53          | 4,229    | 各種電気通信サービス              |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC |  | 49        | 49    | 95          | 7,586    | 建設資材                    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD   |  | 50        | 100   | 102         | 8,102    | 飲料                      |
| SYDNEY AIRPORT              |  | 141       | 100   | 72          | 5,702    | 運送インフラ                  |
| ALS LTD                     |  | 57        | —     | —           | —        | 専門サービス                  |
| AURIZON HOLDINGS LTD        |  | 261       | 280   | 124         | 9,868    | 陸運・鉄道                   |
| HEALTHSCOPE LTD             |  | 140       | 140   | 38          | 3,049    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUSNET SERVICES             |  | 252       | 252   | 40          | 3,211    | 電力                      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD        |  | 300       | 300   | 96          | 7,626    | 保険                      |
| AGL ENERGY LTD              |  | 80        | 82    | 155         | 12,345   | 総合公益事業                  |
| SOUTH32 LTD                 |  | —         | 577   | 94          | 7,494    | 金属・鉱業                   |
| CIMIC GROUP LTD             |  | 10        | 10    | 39          | 3,118    | 建設・土木                   |
| 小 計                         |  | 株 数 ・ 金 額 | 7,276 | 8,772       | 11,911   | 943,365                 |
| 銘 柄 数 < 比 率 >               |  | 61        | 64    | —           | < 2.6% > |                         |
| (ニュージーランド)                  |  |           |       | 千ニュージーランドドル |          |                         |
| CONTACT ENERGY LTD          |  | 40        | 100   | 52          | 3,859    | 電力                      |
| RYMAN HEALTHCARE LTD        |  | 30        | 30    | 27          | 1,995    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| FLETCHER BUILDING LTD       |  | 62        | 62    | 52          | 3,802    | 建設資材                    |
| SPARK NEW ZEALAND LTD       |  | 182       | 182   | 68          | 4,975    | 各種電気通信サービス              |
| MIGHTY RIVER POWER          |  | 86        | 86    | 26          | 1,917    | 電力                      |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD   |  | 126       | 126   | 82          | 6,032    | 運送インフラ                  |

| 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             |
| (ニュージーランド)                   |               | 百株      | 百株      | 千ニュージーランドドル | 千円         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| MERIDIAN ENERGY LTD          |               | 153     | 153     | 40          | 2,986      |                    |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 679     | 739     | 349         | 25,570     |                    |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 7       | 7       | —           | <0.1%>     |                    |
| (イスラエル)                      |               |         |         | 千新シェケル      |            |                    |
| BANK HAPOALIM BM             |               | 94      | 140     | 271         | 7,786      | 銀行                 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         |               | 124     | 124     | 171         | 4,906      | 銀行                 |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP |               | 250     | 250     | 197         | 5,662      | 各種電気通信サービス         |
| DELEK GROUP LTD              |               | 0.4     | 0.4     | 27          | 787        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED     |               | 60      | 60      | 99          | 2,838      | 化学                 |
| NICE SYSTEMS LTD             |               | 7       | 7       | 168         | 4,830      | ソフトウェア             |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD  |               | 95      | 101     | 2,007       | 57,565     | 医薬品                |
| ISRAEL CORP LIMITED/THE      |               | 0.3     | —       | —           | —          | 化学                 |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     |               | 11      | 11      | 46          | 1,345      | 銀行                 |
| AZRIELI GROUP                |               | —       | 4       | 60          | 1,738      | 不動産管理・開発           |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 641     | 697     | 3,050       | 87,462     |                    |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 9       | 9       | —           | <0.2%>     |                    |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 156,718 | 150,589 | —           | 34,773,683 |                    |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1,259   | 1,263   | —           | <96.4%>    |                    |

\* 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。

\* 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。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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)                             | 口             | 口       | 千米ドル    | 千円     | %       |
| AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP       | 3,400         | 3,400   | 64      | 6,973  | 0.0     |
| AMERICAN REALTY CAPITAL PROP       | 11,100        | —       | —       | —      | —       |
| AMERICAN TOWER CORP                | 4,470         | 4,800   | 511     | 55,522 | 0.2     |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT          | 11,400        | 11,400  | 124     | 13,501 | 0.0     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC          | 1,410         | 1,580   | 298     | 32,384 | 0.1     |
| BOSTON PROPERTIES                  | 1,640         | 1,640   | 216     | 23,527 | 0.1     |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC         | —             | 1,900   | 50      | 5,477  | 0.0     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST              | 960           | 960     | 82      | 8,967  | 0.0     |
| COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC | 1,460         | —       | —       | —      | —       |
| CROWN CASTLE INTL CORP             | 3,620         | 3,620   | 323     | 35,128 | 0.1     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC           | 1,340         | 1,800   | 167     | 18,187 | 0.1     |
| DUKE REALTY CORP                   | 4,400         | 4,300   | 101     | 10,955 | 0.0     |
| EQUINIX INC                        | 560           | 760     | 259     | 28,111 | 0.1     |
| EQUITY RESIDENTIAL                 | 3,610         | 4,000   | 287     | 31,184 | 0.1     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC           | 720           | 720     | 168     | 18,235 | 0.1     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC            | —             | 1,170   | 109     | 11,845 | 0.0     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST          | 780           | 780     | 124     | 13,490 | 0.0     |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC      | 5,700         | 6,700   | 198     | 21,538 | 0.1     |
| HCP INC                            | 5,300         | 5,400   | 194     | 21,078 | 0.1     |
| HEALTH CARE REIT INC               | 3,890         | —       | —       | —      | —       |
| HOST HOTELS & RESORTS INC          | 8,100         | 8,100   | 132     | 14,416 | 0.0     |
| IRON MOUNTAIN INC                  | 1,510         | 3,200   | 122     | 13,240 | 0.0     |
| KIMCO REALTY CORP                  | 5,000         | 4,900   | 145     | 15,762 | 0.0     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST             | 1,400         | 1,400   | 51      | 5,554  | 0.0     |
| MACERICH CO /THE                   | 1,460         | 1,460   | 117     | 12,780 | 0.0     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM         | —             | 820     | 84      | 9,127  | 0.0     |
| PLUM CREEK TIMBER CO               | 2,000         | —       | —       | —      | —       |
| PROLOGIS INC                       | 5,800         | 5,800   | 274     | 29,748 | 0.1     |
| PUBLIC STORAGE                     | 1,590         | 1,720   | 455     | 49,395 | 0.1     |
| RAYONIER INC                       | 1,000         | —       | —       | —      | —       |
| REALTY INCOME CORP                 | 2,500         | 3,000   | 192     | 20,837 | 0.1     |
| REGENCY CENTERS CORP               | 1,250         | 1,200   | 95      | 10,327 | 0.0     |
| SL GREEN REALTY CORP               | 990           | 1,270   | 134     | 14,547 | 0.0     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC           | 3,410         | 3,570   | 760     | 82,489 | 0.2     |
| UDR INC                            | 2,500         | 3,200   | 119     | 12,918 | 0.0     |
| VENTAS INC                         | 3,490         | 4,000   | 266     | 28,919 | 0.1     |
| VEREIT INC                         | —             | 11,100  | 108     | 11,762 | 0.0     |
| VORNADO REALTY TRUST               | 1,960         | 2,060   | 199     | 21,647 | 0.1     |
| WELLTOWER INC                      | —             | 3,890   | 290     | 31,516 | 0.1     |
| WEYERHAEUSER CO                    | 5,700         | 8,900   | 275     | 29,875 | 0.1     |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST      | 72,000        | 72,000  | 30      | 3,318  | 0.0     |
| 小 計                                | 口 数 ・ 金 額     | 187,420 | 196,520 | 7,139  | 774,299 |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 36      | 36      | —      | <2.1%>  |

| 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)                              |              | 口       | 口      | 千カナダドル    | 千円     | %   |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS       |              | 1,200   | 1,200  | 26        | 2,208  | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR        |              | 1,986   | 1,986  | 56        | 4,689  | 0.0 |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |              | —       | 700    | 24        | 2,025  | 0.0 |
| 小計                                 | 口 数 ・ 金 額    | 3,186   | 3,886  | 106       | 8,923  |     |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 2       | 3      | —         | <0.0%> |     |
| (イギリス)                             |              |         |        | 千英ポンド     |        |     |
| BRITISH LAND                       |              | 9,900   | 9,900  | 73        | 11,408 | 0.0 |
| HAMMERSON PLC                      |              | 8,600   | 8,600  | 50        | 7,881  | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC                |              | 12,480  | 8,000  | 23        | 3,737  | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC          |              | 8,500   | 8,500  | 100       | 15,633 | 0.0 |
| SEGRO PLC                          |              | 7,800   | 7,800  | 33        | 5,245  | 0.0 |
| 小計                                 | 口 数 ・ 金 額    | 47,280  | 42,800 | 280       | 43,907 |     |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 5       | 5      | —         | <0.1%> |     |
| (ユーロ…フランス)                         |              |         |        | 千ユーロ      |        |     |
| ICADE                              |              | 540     | 540    | 36        | 4,563  | 0.0 |
| KLEPIERRE                          |              | 1,688   | 2,300  | 95        | 11,791 | 0.0 |
| GECINA SA                          |              | 388     | 388    | 49        | 6,089  | 0.0 |
| FONCIERE DES REGIONS               |              | 220     | 220    | 18        | 2,243  | 0.0 |
| UNIBAIL RODAMCO-NA                 |              | 1,090   | 1,140  | 271       | 33,554 | 0.1 |
| ユ ー ロ 計                            | 口 数 ・ 金 額    | 3,926   | 4,588  | 471       | 58,243 |     |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 5       | 5      | —         | <0.2%> |     |
| (香港)                               |              |         |        | 千香港ドル     |        |     |
| LINK REIT                          |              | 26,000  | 28,000 | 1,317     | 18,404 | 0.1 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS        |              | —       | 30,000 | 208       | 2,912  | 0.0 |
| 小計                                 | 口 数 ・ 金 額    | 26,000  | 58,000 | 1,525     | 21,316 |     |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 1       | 2      | —         | <0.1%> |     |
| (シンガポール)                           |              |         |        | 千シンガポールドル |        |     |
| CAPITALAND MALL TRUST              |              | 27,800  | 27,800 | 59        | 4,682  | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT       |              | 19,000  | 19,000 | 46        | 3,666  | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST        |              | 30,000  | 19,000 | 26        | 2,088  | 0.0 |
| SUNTEC REIT                        |              | 29,000  | 29,000 | 48        | 3,806  | 0.0 |
| 小計                                 | 口 数 ・ 金 額    | 105,800 | 94,800 | 180       | 14,244 |     |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 4       | 4      | —         | <0.0%> |     |
| (オーストラリア)                          |              |         |        | 千豪ドル      |        |     |
| MIRVAC GROUP                       |              | 36,000  | 36,000 | 70        | 5,559  | 0.0 |
| GPT GROUP                          |              | 15,600  | 23,000 | 119       | 9,435  | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP                    |              | 6,300   | 6,300  | 81        | 6,486  | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP              |              | 25,800  | 25,800 | 117       | 9,317  | 0.0 |
| DEXUS PROPERTY GROUP               |              | 11,833  | 11,833 | 101       | 8,012  | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                      |              | 18,300  | 18,300 | 131       | 10,449 | 0.0 |
| FEDERATION CENTRES                 |              | 18,500  | —      | —         | —      | —   |
| SCENTRE GROUP                      |              | 57,589  | 57,589 | 267       | 21,208 | 0.1 |
| WESTFIELD CORP                     |              | 21,100  | 21,100 | 220       | 17,479 | 0.0 |
| NOVION PROPERTY GROUP              |              | 28,300  | —      | —         | —      | —   |

| 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    |     |
| (オーストラリア)        |               | 口       | 口       | 千豪ドル  | 千円        | %   |
| VICINITY CENTRES |               | —       | 43,000  | 146   | 11,579    | 0.0 |
| 小 計              | 口 数 ・ 金 額     | 239,322 | 242,922 | 1,256 | 99,530    |     |
|                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 10      | 9       | —     | < 0.3% >  |     |
| 合 計              | 口 数 ・ 金 額     | 612,934 | 643,516 | —     | 1,020,465 |     |
|                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 63      | 64      | —     | < 2.8% >  |     |

\* 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。

\* 比率は、純資産総額に対する投資信託証券評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 |        |          | 当 期 末  |       |
|-------|--------|----------|--------|-------|
|       |        |          | 買 建 額  | 売 建 額 |
| 外 国   | 株式先物取引 | CAN60    | 百万円 26 | 百万円 — |
|       |        | EUR050   | 68     | —     |
|       |        | FT100    | 47     | —     |
|       |        | SPI200   | 21     | —     |
|       |        | SPEMINI  | 356    | —     |
|       |        | SWISSMKT | 17     | —     |
|       |        |          |        |       |

\* 単位未満は切り捨て。

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末         |        |
|--------------|---------------|--------|
|              | 評 価 額         | 比 率    |
| 株式           | 千円 34,773,683 | % 92.2 |
| 投資信託受益証券     | 3,318         | 0.0    |
| 投資証券         | 1,017,146     | 2.7    |
| コール・ローン等、その他 | 1,912,109     | 5.1    |
| 投資信託財産総額     | 37,706,256    | 100.0  |

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 当期末における外貨建て純資産（35,419,182千円）の投資信託財産総額（37,706,256千円）に対する比率は93.9%です。

\* 外貨建て資産は、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。1米ドル＝108.46円、1カナダドル＝83.59円、1英ポンド＝156.26円、1スイスフラン＝111.70円、1スウェーデンクローナ＝13.28円、1ノルウェークローネ＝13.19円、1デンマーククローネ＝16.60円、1ユーロ＝123.49円、1香港ドル＝13.97円、1シンガポールドル＝79.08円、1豪ドル＝79.20円、1ニュージーランドドル＝73.10円、1新シェケル＝28.67円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 74,179,666,673  |
| コール・ローン等        | 456,616,959     |
| 株式(評価額)         | 34,773,683,238  |
| 投資信託受益証券(評価額)   | 3,318,876       |
| 投資証券(評価額)       | 1,017,146,183   |
| 未収入金            | 37,623,757,966  |
| 未収配当金           | 57,272,927      |
| 差入委託証拠金         | 247,870,524     |
| (B) 負債          | 38,105,025,591  |
| 未払金             | 38,095,181,436  |
| 未払解約金           | 8,519,012       |
| 未払利息            | 43              |
| その他未払費用         | 1,325,100       |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 36,074,641,082  |
| 元本              | 25,841,122,270  |
| 次期繰越損益金         | 10,233,518,812  |
| (D) 受益権総口数      | 25,841,122,270口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,960円         |

(注) 期首元本額は28,959,503,568円、期中追加設定元本額は4,365,181,907円、期中一部解約元本額は7,483,563,205円、1口当たり純資産額は1.3960円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

|                                       |                 |
|---------------------------------------|-----------------|
| ・野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)         | 20,076,797,456円 |
| ・野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA(適格機関投資家専用)  | 2,973,020,883円  |
| ・ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA(適格機関投資家専用) | 1,436,065,121円  |
| ・野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型             | 965,727,199円    |
| ・野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型        | 288,188,435円    |
| ・野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)     | 101,323,176円    |

## ○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 829,265,778     |
| 受取配当金              | 823,461,984     |
| 受取利息               | 353,381         |
| その他収益金             | 5,493,180       |
| 支払利息               | △ 42,767        |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 2,966,624,754 |
| 売買益                | 9,857,548,040   |
| 売買損                | △12,824,172,794 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 20,123,694      |
| 取引益                | 176,110,784     |
| 取引損                | △ 155,987,090   |
| (D) 保管費用等          | △ 10,567,284    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 2,127,802,566 |
| (F) 前期繰越損益金        | 13,716,666,690  |
| (G) 追加信託差損益金       | 1,620,611,074   |
| (H) 解約差損益金         | △ 2,975,956,386 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 10,233,518,812  |
| 次期繰越損益金(I)         | 10,233,518,812  |

\* 損益の状況の中で(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。

\* 損益の状況の中で(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。

\* 損益の状況の中で(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。

## ○お知らせ

①デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年5月27日＞

②信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年5月27日＞

③有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞

### ＜お申し込み時の留意点＞

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

（2016年12月6日現在）

| 年 月       | 日  |
|-----------|----|
| 2016年12月  | 26 |
| 2017年 1 月 | 16 |
| 2 月       | 20 |
| 3 月       | －  |
| 4 月       | 14 |
| 5 月       | 29 |
| 6 月       | －  |
| 7 月       | 4  |
| 8 月       | －  |
| 9 月       | 4  |
| 10月       | －  |
| 11月       | －  |
| 12月       | 25 |

※ 2017年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご留意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ（<http://www.nomura-am.co.jp/>）にも掲載いたしております。