

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                   |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
| 商品分類         | 追加型投信／海外／株式／インデックス型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                   |
| 信託期間         | 無期限                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                   |
| 運用方針         | 投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                   |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド                           |
|              | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。） |
| ベビーファンドの運用方法 | <p>①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。</p> <p>②マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態での高位に維持することを基本とします。</p> <p>③安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。</p> <p>イ. 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的</p> <p>ロ. 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的</p> <p>ハ. 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的</p> |                                                   |
| マザーファンドの運用方法 | <p>①主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。</p> <p>②保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。</p> <p>③運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p>                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                   |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 無制限                                               |
|              | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 無制限                                               |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                   |

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

iFree 外国株式インデックス  
（為替ヘッジあり）

運用報告書（全体版）  
第1期  
（決算日 2017年11月30日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9：00～17：00）

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

設定以来の運用実績

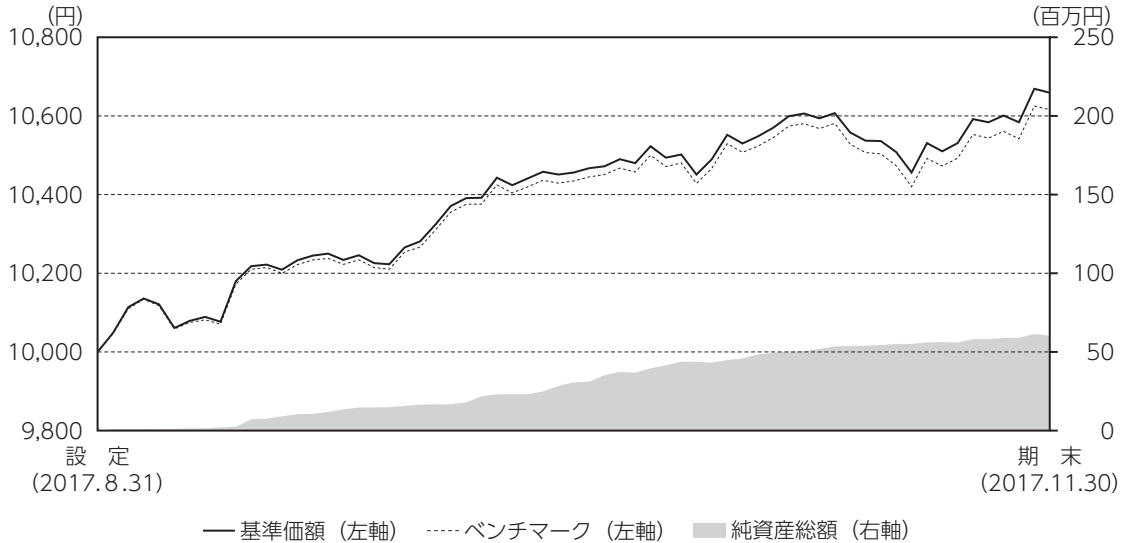
| 決 算 期             | 基 準 価 額 |            |            | MSCIコクサイ指数<br>(円ヘッジ・ベース) |            | 株式組入<br>比 率 | 株 式<br>先物比率 | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総 額 |
|-------------------|---------|------------|------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|--------------------|------------|
|                   |         | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 | (ベンチマーク)                 | 期 中<br>騰落率 |             |             |                      |                    |            |
| 1 期末(2017年11月30日) | 円       | 円          | %          |                          | %          | %           | %           | %                    | %                  | 百万円        |
|                   | 10,659  | 0          | 6.6        | 10,616                   | 6.2        | 92.8        | 3.6         | 0.0                  | 2.5                | 60         |

- (注 1) MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。
- (注 2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,659円

騰落率：6.6%

#### ■基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じてMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なった結果、良好な経済指標や米国の税制改革法案成立に期待して海外株式市場が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。

iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

| 年<br>月<br>日       | 基 準 価 額     |        | MSCIコクサイ指数<br>(円ヘッジ・ベース) |        | 株式組入<br>比 | 株式先物<br>率 | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|-------------------|-------------|--------|--------------------------|--------|-----------|-----------|----------------------|--------------------|
|                   |             | 騰 落 率  | (ベンチマーク)                 | 騰 落 率  |           |           |                      |                    |
| (設定) 2017年 8 月31日 | 円<br>10,000 | %<br>－ | (8/30)<br>10,000         | %<br>－ | %<br>－    | %<br>－    | %<br>－               | %<br>－             |
| 8 月末              | 10,048      | 0.5    | 10,046                   | 0.5    | 95.3      | 2.3       | 0.0                  | 2.7                |
| 9 月末              | 10,281      | 2.8    | 10,266                   | 2.7    | 97.3      | 2.7       | 0.0                  | 2.6                |
| 10月末              | 10,530      | 5.3    | 10,507                   | 5.1    | 94.9      | 2.7       | 0.0                  | 2.5                |
| (期末) 2017年11月30日  | 10,659      | 6.6    | 10,616                   | 6.2    | 92.8      | 3.6       | 0.0                  | 2.5                |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.8.31～2017.11.30)

### ■外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は上昇しました。

設定時より、北朝鮮による6回目の核実験や米国南部に襲来した大型ハリケーン、メキシコ地震など投資家心理が悪化する中、良好な経済指標に支えられ堅調なスタートとなりました。その後も、ECB（欧州中央銀行）が2017年のEU（欧州連合）圏の成長率見通しを引き上げたこと、また米国の良好な経済指標や税制改革法案成立への期待感などが好感され、市況は上昇基調を継続して期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

(2017.8.31～2017.11.30)

### ■当ファンド

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率を期を通じておおむね100%程度に維持しました。

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

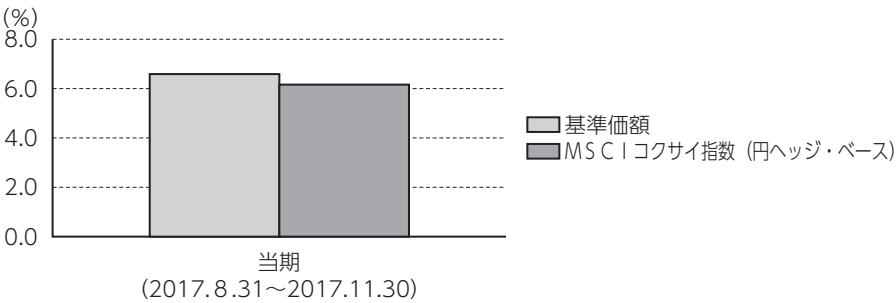
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（投資信託証券、株式先物を含む。）等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））の騰落率は6.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.6%となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。その他、ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、信託報酬・売買手数料や保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2017年8月31日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | （円） | —                          |
| 対基準価額比率    | （％） | —                          |
| 当期の収益      | （円） | —                          |
| 当期の収益以外    | （円） | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | （円） | 659                        |

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

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

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2017.8.31～2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|-----------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬   | 5円                           | 0.052%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,399円です。                       |
| (投 信 会 社) | (3)                          | (0.024) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社) | (2)                          | (0.022) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行) | (1)                          | (0.005) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                                     |
| 売買委託手数料   | 0                            | 0.003   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<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)     | (0)                          | (0.002) |                                                                    |
| (先 物)     | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| (投資信託証券)  | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| 有価証券取引税   | 0                            | 0.002   | 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)     | (0)                          | (0.002) |                                                                    |
| (投資信託証券)  | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| そ の 他 費 用 | 3                            | 0.025   | 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) | (2)                          | (0.023) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・<br>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)   | (0)                          | (0.000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                 |
| 合 計       | 8                            | 0.081   |                                                                    |

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年8月31日から2017年11月30日まで)

|                             | 設 定    |        | 解 約   |       |
|-----------------------------|--------|--------|-------|-------|
|                             | 口 数    | 金 額    | 口 数   | 金 額   |
|                             | 千口     | 千円     | 千口    | 千円    |
| 外国株式インデックス<br>為替ヘッジ型マザーファンド | 34,939 | 61,588 | 1,550 | 2,771 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年8月31日から2017年11月30日まで)

| 項 目               | 当 期                     |
|-------------------|-------------------------|
|                   | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 2,223,621千円             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 24,369,593千円            |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.09                    |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 1      | －     | 1     | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類                     | 当 期 末         |
|-------------------------|---------------|
|                         | 口 数 評 価 額     |
|                         | 千口 千円         |
| 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 33,389 60,280 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目                     | 当 期 末        |
|-------------------------|--------------|
|                         | 評 価 額 比 率    |
|                         | 千円 %         |
| 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 60,280 93.1  |
| コール・ローン等、その他            | 4,449 6.9    |
| 投資信託財産総額                | 64,730 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝112.05円、1 カナダ・ドル＝87.10円、1 オーストラリア・ドル＝84.87円、1 香港ドル＝14.35円、1 シンガポール・ドル＝83.19円、1 ニュージーランド・ドル＝76.68円、1 イギリス・ポンド＝150.33円、1 イスラエル・シェケル＝31.98円、1 スイス・フラン＝113.83円、1 デンマーク・クローネ＝17.84円、1 ノルウェー・クローネ＝13.58円、1 スウェーデン・クローネ＝13.38円、1 ユーロ＝132.81円です。

(注3) 外国株式インデックス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純資産（26,374,381千円）の投資信託財産総額（27,050,287千円）に対する比率は、97.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目                              | 当 期 末       |
|----------------------------------|-------------|
| (A) 資産                           | 64,730,920円 |
| コール・ローン等                         | 3,314,541   |
| 外国株式インデックス<br>為替ヘッジ型マザーファンド(評価額) | 60,280,979  |
| 未収入金                             | 1,135,400   |
| (B) 負債                           | 4,434,226   |
| 未払解約金                            | 4,418,074   |
| 未払信託報酬                           | 15,765      |
| その他未払費用                          | 387         |
| (C) 純資産総額(A－B)                   | 60,296,694  |
| 元本                               | 56,568,708  |
| 次期繰越損益金                          | 3,727,986   |
| (D) 受益権総口数                       | 56,568,708口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)                   | 10,659円     |

\*設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は66,163,866円、同解約元本額は10,595,158円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,659円です。

■損益の状況

当期 自2017年8月31日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期          |
|----------------------|--------------|
| (A) 配当等収益            | △ 10円        |
| 受取利息                 | 1            |
| 支払利息                 | △ 11         |
| (B) 有価証券売買損益         | 1,275,325    |
| 売買益                  | 1,463,257    |
| 売買損                  | △ 187,932    |
| (C) 信託報酬等            | △ 16,152     |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 1,259,163    |
| (E) 追加信託差損益金         | 2,468,823    |
| (配当等相当額)             | (△ 3)        |
| (売買損益相当額)            | ( 2,468,826) |
| (F) 合計(D + E)        | 3,727,986    |
| 次期繰越損益金(F)           | 3,727,986    |
| 追加信託差損益金             | 2,468,823    |
| (配当等相当額)             | (△ 3)        |
| (売買損益相当額)            | ( 2,468,826) |
| 分配準備積立金              | 1,259,173    |
| 繰越損益金                | △ 10         |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目                        | 当 期         |
|----------------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | 0円          |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 1,259,173   |
| (c) 収益調整金                  | 2,468,826   |
| (d) 分配準備積立金                | 0           |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 3,727,999   |
| (f) 分配金                    | 0           |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 3,727,999   |
| (h) 受益権総口数                 | 56,568,708口 |

《お知らせ》

■運用管理費用の引き下げについて

2017年10月2日付で、運用管理費用（信託報酬）の料率および委託会社、販売会社、受託会社への配分を、次のとおり変更しました。

（純資産総額に対して年率、税抜き）

|     | 合計    | 委託会社  | 販売会社  | 受託会社  |
|-----|-------|-------|-------|-------|
| 変更前 | 0.21% | 0.11% | 0.08% | 0.02% |
| 変更後 | 0.19% | 0.09% | 変更なし  | 変更なし  |

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

<補足情報>

当ファンド（iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2017年1月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年11月30日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を10～25ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2017年8月31日から2017年11月30日まで)

| 買                                |       |        |         | 売                                  |      |        |         |
|----------------------------------|-------|--------|---------|------------------------------------|------|--------|---------|
| 銘柄                               | 株数    | 金額     | 平均単価    | 銘柄                                 | 株数   | 金額     | 平均単価    |
|                                  | 千株    | 千円     | 円       |                                    | 千株   | 千円     | 円       |
| APPLE INC (アメリカ)                 | 1.7   | 32,011 | 18,830  | APPLE INC (アメリカ)                   | 1.35 | 23,802 | 17,631  |
| AMAZON.COM INC (アメリカ)            | 0.19  | 22,972 | 120,907 | JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)           | 1.2  | 18,047 | 15,039  |
| JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)         | 1.3   | 19,822 | 15,247  | MICROSOFT CORP (アメリカ)              | 1.95 | 16,649 | 8,537   |
| MICROSOFT CORP (アメリカ)            | 2     | 17,628 | 8,814   | FACEBOOK INC-A (アメリカ)              | 0.85 | 16,465 | 19,371  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)   | 1.5   | 15,480 | 10,320  | AMAZON.COM INC (アメリカ)              | 0.13 | 14,224 | 109,415 |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)            | 0.75  | 14,882 | 19,843  | JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)         | 0.9  | 9,725  | 10,806  |
| HSBC HOLDINGS PLC (イギリス)         | 11.5  | 12,842 | 1,116   | EXXON MOBIL CORP (アメリカ)            | 1    | 9,275  | 9,275   |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL (イギリス) | 3.133 | 11,420 | 3,645   | PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)     | 0.9  | 9,264  | 10,293  |
| ALPHABET INC-CL C (アメリカ)         | 0.1   | 10,918 | 109,188 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ) | 0.4  | 8,297  | 20,742  |
| JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)       | 1.05  | 10,870 | 10,352  | BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)        | 2.7  | 7,739  | 2,866   |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2017年11月30日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（14,973,926千円）の内容です。

(1) 外国株式

| 銘 柄                          | 2017年11月30日現在 |          |        | 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            | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 7.5           | 66       | 7,489  | 情報技術       |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 6             | 86       | 9,741  | 情報技術       |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 3             | 41       | 4,634  | ヘルスケア      |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 51            | 180      | 20,200 | 金融         |
| ABBOTT LABORATORIES          | 112.2         | 623      | 69,875 | ヘルスケア      |
| ARCONIC INC                  | 24            | 57       | 6,472  | 資本財・サービス   |
| VERISK ANALYTICS INC         | 11.35         | 107      | 12,079 | 資本財・サービス   |
| AS VEGAS SANDS CORP          | 24            | 162      | 18,168 | 一般消費財・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 19.5          | 175      | 19,614 | 情報技術       |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 19.5          | 180      | 20,259 | 情報技術       |
| QORVO INC                    | 7             | 53       | 6,015  | 情報技術       |
| AFLAC INC                    | 25            | 217      | 24,424 | 金融         |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 8             | 67       | 7,602  | 一般消費財・サービス |
| ADOBE SYSTEMS INC            | 31.5          | 557      | 62,420 | 情報技術       |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 11            | 40       | 4,541  | 素材         |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 5.5           | 36       | 4,121  | 一般消費財・サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 19            | 36       | 4,100  | 金融         |
| GARMIN LTD                   | 7.5           | 46       | 5,243  | 一般消費財・サービス |

| 銘 柄                          | 2017年11月30日現在 |          |        | 業 種 等      |
|------------------------------|---------------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数           | 評 価 額    |        |            |
|                              |               | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株            | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| AETNA INC                    | 21.94         | 393      | 44,145 | ヘルスケア      |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 14            | 227      | 25,510 | 素材         |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 44.5          | 681      | 76,408 | 資本財・サービス   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | 11.5          | 83       | 9,320  | 情報技術       |
| WR BERKLEY CORP              | 6             | 41       | 4,605  | 金融         |
| AUTOZONE INC                 | 1.9           | 130      | 14,666 | 一般消費財・サービス |
| DOLLAR TREE INC              | 15.99         | 166      | 18,658 | 一般消費財・サービス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 56            | 84       | 9,456  | ヘルスケア      |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 9             | 81       | 9,177  | 公益事業       |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 9             | 96       | 10,778 | 素材         |
| DR HORTON INC                | 23.5          | 119      | 13,339 | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 4.5           | 20       | 2,321  | エネルギー      |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 15.5          | 105      | 11,872 | ヘルスケア      |
| AUTODESK INC                 | 12.5          | 136      | 15,314 | 情報技術       |
| MOODY'S CORP                 | 10            | 149      | 16,789 | 金融         |
| DEVON ENERGY CORP            | 34            | 126      | 14,133 | エネルギー      |
| ALBEMARLE CORP               | 6             | 79       | 8,870  | 素材         |
| ATMOS ENERGY CORP            | 6             | 54       | 6,084  | 公益事業       |

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                            | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|-------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                               |        | 評価額           | 価額      |            |
|                               |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                               | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| ALLIANT ENERGY CORP           | 13     | 58            | 6,540   | 公益事業       |
| CITIGROUP INC                 | 171.8  | 1,289         | 144,453 | 金融         |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING     | 27.5   | 311           | 34,921  | 情報技術       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER       | 32.5   | 250           | 28,091  | 公益事業       |
| ALLEGHANY CORP                | 0.8    | 46            | 5,237   | 金融         |
| DOMINO'S PIZZA INC            | 3      | 53            | 6,022   | 一般消費財・サービス |
| HESS CORP                     | 19.5   | 87            | 9,790   | エネルギー      |
| DAVITA INC                    | 10     | 60            | 6,794   | ヘルスケア      |
| DANAHER CORP                  | 41.3   | 387           | 43,472  | ヘルスケア      |
| FORTIVE CORP                  | 19     | 139           | 15,630  | 資本財・サービス   |
| AVNET INC                     | 11     | 45            | 5,083   | 情報技術       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 36.25  | 253           | 28,351  | 金融         |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A      | 12     | 16            | 1,824   | 一般消費財・サービス |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C      | 17.01  | 20            | 2,321   | 一般消費財・サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     | 37.5   | 149           | 16,710  | 生活必需品      |
| BUNGE LTD                     | 9.5    | 63            | 7,070   | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD           | 24     | 226           | 25,345  | 情報技術       |
| APPLE INC                     | 331    | 5,609         | 628,576 | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 22     | 151           | 17,011  | 金融         |
| BOEING CO/THE                 | 36.5   | 982           | 110,138 | 資本財・サービス   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 9.5    | 71            | 7,969   | 金融         |
| BECTON DICKINSON AND CO       | 14.63  | 331           | 37,192  | ヘルスケア      |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR    | 15     | 38            | 4,344   | 一般消費財・サービス |
| LEIDOS HOLDINGS INC           | 8.5    | 53            | 5,942   | 情報技術       |
| CDK GLOBAL INC                | 11     | 75            | 8,505   | 情報技術       |
| NISOURCE INC                  | 20     | 54            | 6,088   | 公益事業       |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 10.5   | 88            | 9,940   | 資本財・サービス   |
| CR BARD INC                   | 4.9    | 165           | 18,492  | ヘルスケア      |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP  | 65.5   | 356           | 39,932  | 金融         |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    | 255.44 | 1,274         | 142,824 | 電気通信サービス   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B   | 77.7   | 1,475         | 165,288 | 金融         |
| ANSYS INC                     | 4.5    | 65            | 7,390   | 情報技術       |
| H&R BLOCK INC                 | 16     | 41            | 4,637   | 一般消費財・サービス |
| BB&T CORP                     | 54     | 265           | 29,721  | 金融         |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO       | 105    | 660           | 74,003  | ヘルスケア      |
| JPMORGAN CHASE & CO           | 225.5  | 2,339         | 262,097 | 金融         |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 15.5   | 156           | 17,588  | 金融         |
| CIGNA CORP                    | 16.5   | 339           | 38,054  | ヘルスケア      |
| LKQ CORP                      | 20.5   | 80            | 9,073   | 一般消費財・サービス |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD      | 2      | 27            | 3,057   | 金融         |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B     | 14.5   | 85            | 9,618   | 生活必需品      |
| CADENCE DESIGN SYS INC        | 17     | 73            | 8,221   | 情報技術       |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 9.5    | 155           | 17,410  | 金融         |
| DOLLAR GENERAL CORP           | 18.5   | 164           | 18,382  | 一般消費財・サービス |
| SERVICENOW INC                | 11.5   | 138           | 15,538  | 情報技術       |
| CATERPILLAR INC               | 38.5   | 531           | 59,558  | 資本財・サービス   |
| CMS ENERGY CORP               | 17     | 84            | 9,449   | 公益事業       |
| MOSAIC CO/THE                 | 15     | 36            | 4,099   | 素材         |
| DELTA AIR LINES INC           | 10     | 52            | 5,837   | 資本財・サービス   |
| CORNING INC                   | 59     | 191           | 21,472  | 情報技術       |
| CISCO SYSTEMS INC             | 320.5  | 1,201         | 134,598 | 情報技術       |
| MORGAN STANLEY                | 85.5   | 438           | 49,165  | 金融         |

| 銘柄                           | 株数    | 2017年11月30日現在 |        | 業種等        |
|------------------------------|-------|---------------|--------|------------|
|                              |       | 評価額           | 価額     |            |
|                              |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円     |            |
| WABCO HOLDINGS INC           | 3.2   | 47            | 5,372  | 資本財・サービス   |
| MSCI INC                     | 7.3   | 93            | 10,447 | 金融         |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 2.2   | 44            | 5,024  | 資本財・サービス   |
| MIDDLEBY CORP                | 4     | 50            | 5,616  | 資本財・サービス   |
| COTY INC-CL A                | 24.17 | 41            | 4,628  | 生活必需品      |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 10    | 40            | 4,592  | 情報技術       |
| BROADCOM LTD                 | 25.74 | 698           | 78,305 | 情報技術       |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 3     | 38            | 4,340  | ヘルスケア      |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | 2     | 5             | 660    | 一般消費財・サービス |
| ACUITY BRANDS INC            | 3.5   | 59            | 6,684  | 資本財・サービス   |
| ARAMARK                      | 17    | 72            | 8,110  | 一般消費財・サービス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 14    | 52            | 5,890  | 素材         |
| DTE ENERGY COMPANY           | 10.5  | 120           | 13,478 | 公益事業       |
| CENTENE CORP                 | 12    | 118           | 13,312 | ヘルスケア      |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 6     | 72            | 8,130  | 金融         |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 30.5  | 124           | 13,899 | 金融         |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 12    | 79            | 8,930  | 金融         |
| GARTNER INC                  | 5     | 59            | 6,684  | 情報技術       |
| SPLUNK INC                   | 11    | 87            | 9,797  | 情報技術       |
| AGCO CORP                    | 5     | 35            | 3,972  | 資本財・サービス   |
| DOMINION ENERGY INC          | 40    | 336           | 37,648 | 公益事業       |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 27.5  | 170           | 19,070 | 生活必需品      |
| SMITH (A.O.) CORP            | 8     | 50            | 5,602  | 資本財・サービス   |
| DEERE & CO                   | 18.5  | 274           | 30,770 | 資本財・サービス   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 8.5   | 84            | 9,425  | 情報技術       |
| TIME WARNER INC              | 47.66 | 433           | 48,554 | 一般消費財・サービス |
| VMWARE INC-CLASS A           | 5     | 59            | 6,690  | 情報技術       |
| NASDAQ INC                   | 8.5   | 66            | 7,482  | 金融         |
| VAIL RESORTS INC             | 2.4   | 53            | 6,019  | 一般消費財・サービス |
| EAST WEST BANCORP INC        | 8.5   | 52            | 5,863  | 金融         |
| TARGA RESOURCES CORP         | 11    | 45            | 5,143  | エネルギー      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 4.5   | 73            | 8,277  | 金融         |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 4.5   | 47            | 5,307  | 金融         |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 18.5  | 163           | 18,324 | 公益事業       |
| MEDNAX INC                   | 8     | 40            | 4,498  | ヘルスケア      |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 7.5   | 84            | 9,434  | 一般消費財・サービス |
| TELEFLEX INC                 | 3     | 79            | 8,888  | ヘルスケア      |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 5     | 54            | 6,086  | 資本財・サービス   |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 6.5   | 38            | 4,288  | ヘルスケア      |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | 7     | 46            | 5,165  | 資本財・サービス   |
| IDEX CORP                    | 4.5   | 59            | 6,680  | 資本財・サービス   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 52.5  | 378           | 42,360 | 生活必需品      |
| ROLLINS INC                  | 7     | 32            | 3,616  | 資本財・サービス   |
| AMETEK INC                   | 14.75 | 105           | 11,846 | 資本財・サービス   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 14    | 65            | 7,339  | 生活必需品      |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 10    | 41            | 4,678  | 資本財・サービス   |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 21    | 220           | 24,709 | 素材         |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 28    | 497           | 55,698 | 生活必需品      |
| SCANA CORP                   | 7     | 30            | 3,430  | 公益事業       |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 4     | 79            | 8,902  | 金融         |
| WR GRACE & CO                | 5.5   | 40            | 4,548  | 素材         |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 1.4   | 42            | 4,737  | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                            | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|-------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                               |        | 評価額           | 価額      |            |
|                               |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                               | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| LEUCADIA NATIONAL CORP        | 14     | 37            | 4,177   | 金融         |
| UGI CORP                      | 10     | 47            | 5,377   | 公益事業       |
| CUMMINS INC                   | 11     | 180           | 20,277  | 資本財・サービス   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 44.5   | 275           | 30,919  | 情報技術       |
| SABRE CORP                    | 16     | 31            | 3,553   | 情報技術       |
| CDW CORP/DE                   | 8      | 55            | 6,177   | 情報技術       |
| SIGNATURE BANK                | 3.5    | 48            | 5,440   | 金融         |
| COSTAR GROUP INC              | 2.5    | 75            | 8,455   | 情報技術       |
| SVB FINANCIAL GROUP           | 3      | 68            | 7,629   | 金融         |
| AMERCO                        | 0.7    | 25            | 2,883   | 資本財・サービス   |
| MERCADOLIBRE INC              | 2.8    | 74            | 8,398   | 情報技術       |
| HANESBRANDS INC               | 29     | 58            | 6,599   | 一般消費財・サービス |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 4.5    | 51            | 5,743   | 情報技術       |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 10.83  | 82            | 9,290   | 一般消費財・サービス |
| COMMScope HOLDING CO INC      | 10.5   | 38            | 4,287   | 情報技術       |
| DEXCOM INC                    | 4      | 23            | 2,661   | ヘルスケア      |
| DIAMONDBACK ENERGY INC        | 6      | 64            | 7,270   | エネルギー      |
| SEATTLE GENETICS INC          | 4      | 23            | 2,650   | ヘルスケア      |
| ALIGN TECHNOLOGY INC          | 5      | 129           | 14,475  | ヘルスケア      |
| TRANSNIGM GROUP INC           | 3.5    | 97            | 10,954  | 資本財・サービス   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC          | 25     | 90            | 10,174  | 資本財・サービス   |
| KINDER MORGAN INC             | 124.96 | 209           | 23,466  | エネルギー      |
| HCA HEALTHCARE INC            | 17.5   | 140           | 15,714  | ヘルスケア      |
| CABOT OIL & GAS CORP          | 29.5   | 86            | 9,642   | エネルギー      |
| T-MOBILE US INC               | 19.5   | 120           | 13,509  | 電気通信サービス   |
| ZILLOW GROUP INC - C          | 7      | 28            | 3,205   | 情報技術       |
| COCA-COLA CO/THE              | 253    | 1,151         | 128,986 | 生活必需品      |
| EXPEDITORS INTL WASH INC      | 12.5   | 80            | 9,021   | 資本財・サービス   |
| EATON VANCE CORP              | 6      | 32            | 3,672   | 金融         |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 22     | 94            | 10,631  | 金融         |
| CSX CORP                      | 58     | 315           | 35,380  | 資本財・サービス   |
| FLUOR CORP                    | 7      | 33            | 3,780   | 資本財・サービス   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS  | 5.5    | 86            | 9,676   | ヘルスケア      |
| EXPEDIA INC                   | 8      | 97            | 10,937  | 一般消費財・サービス |
| AUTOLIV INC                   | 5.5    | 69            | 7,815   | 一般消費財・サービス |
| AMAZON.COM INC                | 26     | 3,019         | 338,312 | 一般消費財・サービス |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A    | 16     | 42            | 4,725   | エネルギー      |
| FLOWERVE CORP                 | 9      | 37            | 4,186   | 資本財・サービス   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP     | 13     | 151           | 16,951  | ヘルスケア      |
| EXXON MOBIL CORP              | 269.26 | 2,215         | 248,213 | エネルギー      |
| FLIR SYSTEMS INC              | 8      | 37            | 4,173   | 情報技術       |
| AES CORP                      | 40     | 42            | 4,755   | 公益事業       |
| L3 TECHNOLOGIES INC           | 4.5    | 88            | 9,905   | 資本財・サービス   |
| EVEREST RE GROUP LTD          | 2      | 44            | 4,991   | 金融         |
| EOG RESOURCES INC             | 36.5   | 366           | 41,102  | エネルギー      |
| EQT CORP                      | 10     | 58            | 6,511   | エネルギー      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC       | 12.5   | 69            | 7,751   | 情報技術       |
| AMERISOURCEBERGEN CORP        | 10     | 84            | 9,486   | ヘルスケア      |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 19.5   | 133           | 15,008  | ヘルスケア      |
| FORD MOTOR CO                 | 247.5  | 310           | 34,831  | 一般消費財・サービス |
| TESARO INC                    | 2      | 16            | 1,861   | ヘルスケア      |
| MACY'S INC                    | 22     | 52            | 5,911   | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                            | 株数    | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|-------------------------------|-------|---------------|---------|------------|
|                               |       | 評価額           | 価額      |            |
|                               |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                               | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A    | 11    | 20            | 2,325   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A          | 12.16 | 39            | 4,398   | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C    | 12.5  | 22            | 2,490   | 一般消費財・サービス |
| AERCAP HOLDINGS NV            | 8.5   | 43            | 4,927   | 資本財・サービス   |
| FORTINET INC                  | 10.5  | 43            | 4,875   | 情報技術       |
| MARKEL CORP                   | 0.8   | 88            | 9,893   | 金融         |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A    | 8     | 15            | 1,762   | エネルギー      |
| NEXTERA ENERGY INC            | 30.8  | 485           | 54,448  | 公益事業       |
| FREEMPORT-MCMORAN INC         | 94.5  | 132           | 14,834  | 素材         |
| US BANCORP                    | 104   | 569           | 63,812  | 金融         |
| UNITED RENTALS INC            | 4.5   | 71            | 7,958   | 資本財・サービス   |
| F5 NETWORKS INC               | 3     | 38            | 4,365   | 情報技術       |
| FASTENAL CO                   | 20.5  | 105           | 11,769  | 資本財・サービス   |
| FISERV INC                    | 12.5  | 160           | 18,028  | 情報技術       |
| GENERAL ELECTRIC CO           | 541.5 | 1,000         | 112,127 | 資本財・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING | 12.5  | 69            | 7,744   | 一般消費財・サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO     | 11.5  | 36            | 4,141   | 一般消費財・サービス |
| GENERAL MOTORS CO             | 89    | 389           | 43,689  | 一般消費財・サービス |
| TRIPADVISOR INC               | 7     | 24            | 2,711   | 一般消費財・サービス |
| GENERAL DYNAMICS CORP         | 16    | 326           | 36,603  | 資本財・サービス   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC       | 22.6  | 545           | 61,120  | 金融         |
| ALPHABET INC-CL A             | 19    | 1,971         | 220,853 | 情報技術       |
| ALPHABET INC-CL C             | 19.91 | 2,034         | 227,923 | 情報技術       |
| GENERAL MILLS INC             | 37.5  | 211           | 23,673  | 生活必需品      |
| FIRSTENERGY CORP              | 30.17 | 101           | 11,382  | 公益事業       |
| GENUINE PARTS CO              | 8     | 73            | 8,202   | 一般消費財・サービス |
| IHS MARKIT LTD                | 26.05 | 115           | 12,889  | 資本財・サービス   |
| FIFTH THIRD BANCORP           | 45.5  | 138           | 15,529  | 金融         |
| HARRIS CORP                   | 3.72  | 107           | 12,035  | 情報技術       |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC   | 9.5   | 46            | 5,242   | 資本財・サービス   |
| HALLIBURTON CO                | 59.5  | 245           | 27,534  | エネルギー      |
| HOME DEPOT INC                | 77    | 1,364         | 152,928 | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC                  | 2.5   | 25            | 2,849   | 金融         |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     | 76.5  | 110           | 12,412  | 金融         |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE  | 3.5   | 83            | 9,399   | 資本財・サービス   |
| HERSHEY CO/THE                | 9.5   | 104           | 11,762  | 生活必需品      |
| HARLEY-DAVIDSON INC           | 14    | 68            | 7,683   | 一般消費財・サービス |
| HUMANA INC                    | 9.5   | 237           | 26,625  | ヘルスケア      |
| NXP SEMICONDUCTORS NV         | 20.5  | 231           | 25,956  | 情報技術       |
| HELMERICH & PAYNE             | 6     | 34            | 3,834   | エネルギー      |
| HENRY SCHEIN INC              | 11    | 77            | 8,664   | ヘルスケア      |
| HP INC                        | 107.5 | 230           | 25,813  | 情報技術       |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    | 102.5 | 143           | 16,044  | 情報技術       |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C  | 11    | 44            | 5,041   | 一般消費財・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP            | 11    | 48            | 5,463   | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A  | 8.5   | 34            | 3,886   | 一般消費財・サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD        | 8     | 76            | 8,626   | 金融         |
| KRAFT HEINZ CO/THE            | 40    | 324           | 36,344  | 生活必需品      |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP   | 57.5  | 882           | 98,930  | 情報技術       |
| INTERNATIONAL PAPER CO        | 23.5  | 130           | 14,619  | 素材         |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI  | 9     | 60            | 6,743   | 資本財・サービス   |
| ZOETIS INC                    | 30.5  | 218           | 24,472  | ヘルスケア      |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 16.65  | 143           | 16,057  | 資本財・サービス   |
| CHENIERE ENERGY INC          | 10     | 48            | 5,378   | エネルギー      |
| ALLEGION PLC                 | 5.5    | 45            | 5,111   | 資本財・サービス   |
| LEGGETT & PLATT INC          | 6.5    | 31            | 3,503   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 35.86  | 112           | 12,564  | 一般消費財・サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 15     | 103           | 11,613  | 資本財・サービス   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 28.5   | 84            | 9,455   | 情報技術       |
| JM SMUCKER CO/THE            | 6      | 70            | 7,910   | 生活必需品      |
| JOHNSON & JOHNSON            | 169.64 | 2,371         | 265,753 | ヘルスケア      |
| ABBVIE INC                   | 102.66 | 983           | 110,222 | ヘルスケア      |
| HOLOGIC INC                  | 18     | 76            | 8,525   | ヘルスケア      |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 23     | 274           | 30,704  | 生活必需品      |
| KROGER CO                    | 56     | 136           | 15,297  | 生活必需品      |
| KLA-TENCOR CORP              | 11     | 110           | 12,368  | 情報技術       |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 16.7   | 535           | 60,021  | 資本財・サービス   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 5.3    | 95            | 10,661  | 情報技術       |
| L BRANDS INC                 | 13.5   | 70            | 7,946   | 一般消費財・サービス |
| LOWE'S COS INC               | 54     | 449           | 50,402  | 一般消費財・サービス |
| ELI LILLY & CO               | 61     | 518           | 58,070  | ヘルスケア      |
| LAM RESEARCH CORP            | 10.5   | 204           | 22,899  | 情報技術       |
| RANGE RESOURCES CORP         | 10     | 18            | 2,016   | エネルギー      |
| JONES LANG LASALLE INC       | 3      | 45            | 5,098   | 不動産        |
| LOEWS CORP                   | 18     | 90            | 10,151  | 金融         |
| MCDONALD NATIONAL CORP       | 13     | 99            | 11,150  | 金融         |
| LC DONALD'S CORP             | 52     | 886           | 99,302  | 一般消費財・サービス |
| 3M CO                        | 38.5   | 916           | 102,675 | 資本財・サービス   |
| FACEBOOK INC-A               | 149    | 2,609         | 292,387 | 情報技術       |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | 12.17  | 94            | 10,635  | 情報技術       |
| MANPOWERGROUP INC            | 3.5    | 45            | 5,090   | 資本財・サービス   |
| S&P GLOBAL INC               | 16.9   | 278           | 31,194  | 金融         |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 3.5    | 72            | 8,177   | 素材         |
| CONCHO RESOURCES INC         | 9.5    | 130           | 14,637  | エネルギー      |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | 5.33   | 16            | 1,900   | ヘルスケア      |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | 38.5   | 62            | 6,975   | 情報技術       |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | 8      | 28            | 3,168   | 電気通信サービス   |
| PHILLIPS 66                  | 25.97  | 246           | 27,618  | エネルギー      |
| MURPHY OIL CORP              | 12.6   | 35            | 3,970   | エネルギー      |
| TECHNIPFMC PLC               | 29     | 79            | 8,958   | エネルギー      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 28     | 94            | 10,557  | 一般消費財・サービス |
| MATTEL INC                   | 14     | 25            | 2,861   | 一般消費財・サービス |
| DXC TECHNOLOGY CO            | 16.88  | 161           | 18,066  | 情報技術       |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 7      | 71            | 8,009   | 生活必需品      |
| MYLAN NV                     | 26.5   | 97            | 10,944  | ヘルスケア      |
| METLIFE INC                  | 59     | 315           | 35,401  | 金融         |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 22     | 48            | 5,474   | 情報技術       |
| ARISTA NETWORKS INC          | 2.5    | 58            | 6,560   | 情報技術       |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 5      | 24            | 2,788   | 金融         |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 10.85  | 102           | 11,448  | 情報技術       |
| MONSANTO CO                  | 27.5   | 323           | 36,270  | 素材         |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1.5    | 93            | 10,512  | ヘルスケア      |
| BAKER HUGHES A GE CO         | 23.31  | 69            | 7,830   | エネルギー      |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 7.5    | 142           | 15,978  | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC    | 5.36   | 31            | 3,569   | 金融         |
| MERCK & CO. INC.             | 175.37 | 970           | 108,783 | ヘルスケア      |
| DOWDUPONT INC                | 150.3  | 1,078         | 120,885 | 素材         |
| MASCO CORP                   | 22     | 92            | 10,360  | 資本財・サービス   |
| M & T BANK CORP              | 8.32   | 140           | 15,765  | 金融         |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 31     | 259           | 29,038  | 金融         |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 19.45  | 246           | 27,566  | 一般消費財・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 8      | 85            | 9,550   | 情報技術       |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 11     | 64            | 7,228   | 一般消費財・サービス |
| VANTIV INC - CL A            | 8.6    | 62            | 6,962   | 情報技術       |
| NETAPP INC                   | 16     | 89            | 10,080  | 情報技術       |
| NIKE INC -CL B               | 83     | 500           | 56,135  | 一般消費財・サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 19     | 259           | 29,041  | 資本財・サービス   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 16.5   | 142           | 16,007  | 情報技術       |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 10.5   | 92            | 10,400  | 金融         |
| ALLY FINANCIAL INC           | 33     | 87            | 9,857   | 金融         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 10.5   | 322           | 36,082  | 資本財・サービス   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 16     | 163           | 18,295  | 一般消費財・サービス |
| NEWMONT MINING CORP          | 31.5   | 115           | 12,918  | 素材         |
| MCKESSON CORP                | 12.5   | 185           | 20,746  | ヘルスケア      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 18     | 93            | 10,510  | 情報技術       |
| XYLEM INC                    | 13     | 88            | 9,934   | 資本財・サービス   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 99.5   | 1,021         | 114,477 | 生活必需品      |
| NUCOR CORP                   | 21.5   | 123           | 13,818  | 素材         |
| WESTERN UNION CO             | 36     | 70            | 7,946   | 情報技術       |
| NEWELL BRANDS INC            | 27.58  | 84            | 9,428   | 一般消費財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 45.5   | 318           | 35,636  | エネルギー      |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 8      | 70            | 7,872   | 一般消費財・サービス |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | 2      | 23            | 2,578   | 生活必需品      |
| PAYCHEX INC                  | 21.5   | 143           | 16,039  | 情報技術       |
| PATTERSON COS INC            | 3      | 11            | 1,242   | ヘルスケア      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 5.5    | 129           | 14,563  | 一般消費財・サービス |
| ALTRIA GROUP INC             | 120    | 808           | 90,585  | 生活必需品      |
| P G & E CORP                 | 33     | 181           | 20,359  | 公益事業       |
| PFIZER INC                   | 373.58 | 1,352         | 151,573 | ヘルスケア      |
| ALKERMES PLC                 | 10.5   | 54            | 6,053   | ヘルスケア      |
| XCEL ENERGY INC              | 31.5   | 161           | 18,092  | 公益事業       |
| STRYKER CORP                 | 21     | 323           | 36,260  | ヘルスケア      |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 7.7    | 141           | 15,902  | 資本財・サービス   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 11.5   | 173           | 19,478  | エネルギー      |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 4      | 51            | 5,784   | 一般消費財・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 164.7  | 1,472         | 164,947 | 生活必需品      |
| EXELON CORP                  | 59.54  | 248           | 27,813  | 公益事業       |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 14     | 150           | 16,843  | ヘルスケア      |
| NVR INC                      | 0.2    | 69            | 7,772   | 一般消費財・サービス |
| CONOCOPHILLIPS               | 75.5   | 383           | 42,916  | エネルギー      |
| PEPSICO INC                  | 91.85  | 1,073         | 120,249 | 生活必需品      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 26     | 301           | 33,756  | 金融         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 13.5   | 121           | 13,667  | 公益事業       |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 39.5   | 580           | 65,039  | 情報技術       |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 6      | 32            | 3,600   | 金融         |
| PENTAIR PLC                  | 10.25  | 71            | 7,961   | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 株数    | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|---------------|---------|------------|
|                              |       | 評価額           | 価額      |            |
|                              |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| QUALCOMM INC                 | 94.5  | 628           | 70,436  | 情報技術       |
| INVESCO LTD                  | 25.5  | 92            | 10,314  | 金融         |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 5     | 49            | 5,599   | 一般消費財・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 18    | 128           | 14,428  | 金融         |
| RAYTHEON COMPANY             | 19.5  | 367           | 41,204  | 資本財・サービス   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 4.5   | 36            | 4,102   | 一般消費財・サービス |
| RED HAT INC                  | 12.8  | 159           | 17,854  | 情報技術       |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 5     | 179           | 20,092  | ヘルスケア      |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 15    | 96            | 10,808  | 資本財・サービス   |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 3.2   | 555           | 62,190  | 一般消費財・サービス |
| ROSS STORES INC              | 26    | 197           | 22,126  | 一般消費財・サービス |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 5.5   | 63            | 7,092   | 素材         |
| RESMED INC                   | 9.5   | 80            | 9,074   | ヘルスケア      |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 8.5   | 82            | 9,269   | ヘルスケア      |
| ROBERT HALF INTL INC         | 8     | 45            | 5,093   | 資本財・サービス   |
| RALPH LAUREN CORP            | 4     | 37            | 4,242   | 一般消費財・サービス |
| AUTONATION INC               | 6.5   | 35            | 4,032   | 一般消費財・サービス |
| ROCKWELL COLLINS INC         | 10.51 | 138           | 15,542  | 資本財・サービス   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 69.5  | 115           | 12,903  | 金融         |
| CHEVRON CORP                 | 121.5 | 1,423         | 159,529 | エネルギー      |
| EDISON INTERNATIONAL         | 19    | 154           | 17,331  | 公益事業       |
| TESLA INC                    | 8.3   | 255           | 28,601  | 一般消費財・サービス |
| SYMANTEC CORP                | 39.5  | 112           | 12,645  | 情報技術       |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 10.02 | 167           | 18,818  | 資本財・サービス   |
| SYNOPSIS INC                 | 8     | 69            | 7,778   | 情報技術       |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 13.23 | 438           | 49,167  | 一般消費財・サービス |
| CBRE GROUP INC - A           | 20    | 85            | 9,634   | 不動産        |
| TWITTER INC                  | 38    | 79            | 8,852   | 情報技術       |
| SOUTHERN CO/THE              | 62    | 316           | 35,492  | 公益事業       |
| SYSCO CORP                   | 30.5  | 175           | 19,719  | 生活必需品      |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 17    | 228           | 25,625  | 金融         |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 10    | 69            | 7,818   | 金融         |
| STERICYCLE INC               | 5     | 32            | 3,657   | 資本財・サービス   |
| STEEL DYNAMICS INC           | 13    | 49            | 5,516   | 素材         |
| SCHLUMBERGER LTD             | 87.93 | 546           | 61,233  | エネルギー      |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 10.5  | 52            | 5,901   | 資本財・サービス   |
| AT&T INC                     | 395.7 | 1,443         | 161,745 | 電気通信サービス   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 9     | 52            | 5,937   | 資本財・サービス   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 5.4   | 212           | 23,837  | 素材         |
| SEMPRA ENERGY                | 14    | 168           | 18,865  | 公益事業       |
| TIFFANY & CO                 | 7.5   | 69            | 7,777   | 一般消費財・サービス |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 17    | 65            | 7,381   | 情報技術       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 61.5  | 595           | 66,760  | 情報技術       |
| SALESFORCE.COM INC           | 42.5  | 440           | 49,302  | 情報技術       |
| SIGNET JEWELERS LTD          | 4     | 20            | 2,347   | 一般消費財・サービス |
| WESTROCK CO                  | 17.12 | 103           | 11,559  | 素材         |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 60.53 | 230           | 25,834  | 資本財・サービス   |
| ANDEAVOR                     | 10.5  | 110           | 12,371  | エネルギー      |
| UNION PACIFIC CORP           | 50    | 614           | 68,877  | 資本財・サービス   |
| MARATHON OIL CORP            | 61    | 89            | 10,081  | エネルギー      |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 35.5  | 217           | 24,423  | エネルギー      |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 49.5  | 584           | 65,537  | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 45     | 535           | 60,022  | 資本財・サービス   |
| UNUM GROUP                   | 12     | 67            | 7,586   | 金融         |
| SPRINT CORP                  | 41.14  | 24            | 2,798   | 電気通信サービス   |
| ANTERO RESOURCES CORP        | 10     | 18            | 2,102   | エネルギー      |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 9.53   | 96            | 10,818  | ヘルスケア      |
| VOYA FINANCIAL INC           | 11     | 48            | 5,414   | 金融         |
| AMEREN CORPORATION           | 12.5   | 79            | 8,919   | 公益事業       |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 61.6   | 1,372         | 153,838 | ヘルスケア      |
| VERISIGN INC                 | 7.5    | 86            | 9,642   | 情報技術       |
| VALERO ENERGY CORP           | 27     | 225           | 25,213  | エネルギー      |
| ULTA BEAUTY INC              | 3.3    | 73            | 8,249   | 一般消費財・サービス |
| FNF GROUP                    | 17.5   | 70            | 7,884   | 金融         |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 6      | 64            | 7,225   | ヘルスケア      |
| ANTHEM INC                   | 16.5   | 375           | 42,025  | ヘルスケア      |
| WALT DISNEY CO/THE           | 97.5   | 1,026         | 114,973 | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO             | 303.87 | 1,722         | 192,987 | 金融         |
| FOOT LOCKER INC              | 7      | 29            | 3,340   | 一般消費財・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 27.5   | 227           | 25,458  | 資本財・サービス   |
| WILLIAMS COS INC             | 48     | 135           | 15,231  | エネルギー      |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 10.5   | 72            | 8,160   | 一般消費財・サービス |
| WHIRLPOOL CORP               | 5      | 84            | 9,467   | 一般消費財・サービス |
| WAL-MART STORES INC          | 98     | 956           | 107,129 | 生活必需品      |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 12.5   | 145           | 16,320  | ヘルスケア      |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 64     | 20            | 2,309   | エネルギー      |
| WYNN RESORTS LTD             | 5      | 78            | 8,743   | 一般消費財・サービス |
| XEROX CORP                   | 9.39   | 27            | 3,082   | 情報技術       |
| WABTEC CORP                  | 5      | 38            | 4,313   | 資本財・サービス   |
| TJX COMPANIES INC            | 40.5   | 302           | 33,935  | 一般消費財・サービス |
| WATERS CORP                  | 4.5    | 88            | 9,866   | ヘルスケア      |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | 3.5    | 21            | 2,435   | 資本財・サービス   |
| ALLERGAN PLC                 | 21.49  | 377           | 42,305  | ヘルスケア      |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 56     | 402           | 45,128  | 生活必需品      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 8.13   | 129           | 14,490  | 金融         |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 16.95  | 137           | 15,383  | 情報技術       |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 22     | 152           | 17,073  | 公益事業       |
| WESTAR ENERGY INC            | 9      | 50            | 5,676   | 公益事業       |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 35     | 184           | 20,667  | 公益事業       |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 115.5  | 1,268         | 142,178 | 情報技術       |
| PPL CORP                     | 46     | 168           | 18,869  | 公益事業       |
| PULTEGROUP INC               | 19     | 64            | 7,197   | 一般消費財・サービス |
| PPG INDUSTRIES INC           | 17.1   | 200           | 22,419  | 素材         |
| NORTHERN TRUST CORP          | 12.5   | 122           | 13,759  | 金融         |
| NVIDIA CORP                  | 38     | 746           | 83,633  | 情報技術       |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 30.53  | 426           | 47,800  | 金融         |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A | 29     | 70            | 7,951   | 一般消費財・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC       | 12     | 43            | 4,913   | 資本財・サービス   |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 19.5   | 159           | 17,921  | 生活必需品      |
| NETFLIX INC                  | 28     | 526           | 59,030  | 一般消費財・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 25.6   | 493           | 55,252  | ヘルスケア      |
| TORCHMARK CORP               | 6.5    | 57            | 6,488   | 金融         |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 9      | 86            | 9,729   | 金融         |
| TEXTRON INC                  | 16     | 87            | 9,831   | 資本財・サービス   |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 66.5   | 213           | 23,918  | 一般消費財・サービス |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 32     | 100           | 11,222  | 一般消費財・サービス |
| NEWS CORP - CLASS A          | 29     | 47            | 5,312   | 一般消費財・サービス |
| OGE ENERGY CORP              | 12     | 42            | 4,743   | 公益事業       |
| OMNICOM GROUP                | 13.5   | 98            | 11,031  | 一般消費財・サービス |
| ORACLE CORP                  | 197    | 955           | 107,102 | 情報技術       |
| MASTERCARD INC - A           | 61     | 904           | 101,397 | 情報技術       |
| ONEOK INC                    | 22.5   | 113           | 12,714  | エネルギー      |
| CENTURYLINK INC              | 54.39  | 79            | 8,861   | 電気通信サービス   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 6      | 157           | 17,630  | 資本財・サービス   |
| YUM! BRANDS INC              | 21     | 171           | 19,250  | 一般消費財・サービス |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 4      | 93            | 10,452  | 情報技術       |
| MOLSON COORS BREWING CO-B    | 12.5   | 95            | 10,717  | 生活必需品      |
| NOBLE ENERGY INC             | 24.5   | 63            | 7,112   | エネルギー      |
| BANK OF AMERICA CORP         | 633.63 | 1,791         | 200,783 | 金融         |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 11     | 91            | 10,263  | ヘルスケア      |
| NORDSTROM INC                | 8      | 36            | 4,101   | 一般消費財・サービス |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 48.5   | 468           | 52,496  | 金融         |
| ANALOG DEVICES INC           | 23.44  | 200           | 22,498  | 情報技術       |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 58     | 62            | 7,038   | 情報技術       |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 17.08  | 86            | 9,735   | 金融         |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 61.7   | 372           | 41,688  | 金融         |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 35     | 167           | 18,777  | エネルギー      |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 12     | 126           | 14,162  | 情報技術       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 11     | 137           | 15,369  | 一般消費財・サービス |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | 12     | 36            | 4,047   | エネルギー      |
| MALLINCKRODT PLC             | 7      | 15            | 1,735   | ヘルスケア      |
| AVERY DENNISON CORP          | 6.5    | 72            | 8,148   | 素材         |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 38     | 274           | 30,703  | 情報技術       |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 39     | 249           | 27,910  | 資本財・サービス   |
| AON PLC                      | 17     | 238           | 26,757  | 金融         |
| AMGEN INC                    | 47.5   | 818           | 91,667  | ヘルスケア      |
| CORE LABORATORIES N.V.       | 4      | 39            | 4,463   | エネルギー      |
| TAPESTRY INC                 | 18     | 74            | 8,372   | 一般消費財・サービス |
| EATON CORP PLC               | 26.62  | 204           | 22,919  | 資本財・サービス   |
| CELGENE CORP                 | 48.5   | 500           | 56,039  | ヘルスケア      |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 11.5   | 246           | 27,621  | 生活必需品      |
| APPLIED MATERIALS INC        | 69.1   | 365           | 40,966  | 情報技術       |
| CIT GROUP INC                | 9      | 44            | 5,014   | 金融         |
| CIMAREX ENERGY CO            | 5      | 57            | 6,399   | エネルギー      |
| CME GROUP INC                | 23     | 340           | 38,098  | 金融         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 21.89  | 71            | 7,998   | エネルギー      |
| ECOLAB INC                   | 17     | 229           | 25,715  | 素材         |
| EQUIFAX INC                  | 8.5    | 95            | 10,729  | 資本財・サービス   |
| GAP INC/THE                  | 13     | 42            | 4,734   | 一般消費財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC          | 85     | 626           | 70,165  | ヘルスケア      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 10.76  | 96            | 10,785  | 生活必需品      |
| HORMEL FOODS CORP            | 22     | 79            | 8,871   | 生活必需品      |
| STATE STREET CORP            | 22.5   | 213           | 23,870  | 金融         |
| SUNTRUST BANKS INC           | 34     | 208           | 23,353  | 金融         |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 74     | 358           | 40,148  | 金融         |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 29.5   | 192           | 21,545  | ヘルスケア      |

| 銘柄                           | 株数    | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|---------------|---------|------------|
|                              |       | 評価額           | 価額      |            |
|                              |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| CAMPBELL SOUP CO             | 13    | 63            | 7,136   | 生活必需品      |
| CROWN HOLDINGS INC           | 8     | 47            | 5,308   | 素材         |
| CARDINAL HEALTH INC          | 18.5  | 109           | 12,253  | ヘルスケア      |
| FEDEX CORP                   | 16.4  | 370           | 41,517  | 資本財・サービス   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 30    | 272           | 30,579  | 金融         |
| FMC CORP                     | 7.5   | 69            | 7,833   | 素材         |
| FLEX LTD                     | 45    | 81            | 9,131   | 情報技術       |
| CERNER CORP                  | 18.5  | 129           | 14,462  | ヘルスケア      |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 6.5   | 100           | 11,256  | 素材         |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 9.5   | 82            | 9,260   | 情報技術       |
| INTEL CORP                   | 301.5 | 1,325         | 148,476 | 情報技術       |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 28    | 56            | 6,290   | 一般消費財・サービス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 22    | 126           | 14,211  | 金融         |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 20    | 331           | 37,173  | 資本財・サービス   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 80    | 43            | 4,912   | 一般消費財・サービス |
| ILLUMINA INC                 | 9.1   | 207           | 23,195  | ヘルスケア      |
| SEALED AIR CORP              | 14.5  | 68            | 7,691   | 素材         |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 7.5   | 295           | 33,135  | ヘルスケア      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 8.5   | 86            | 9,720   | 情報技術       |
| SNAP-ON INC                  | 3     | 50            | 5,621   | 資本財・サービス   |
| CARMAX INC                   | 12    | 82            | 9,210   | 一般消費財・サービス |
| COMERICA INC                 | 11    | 91            | 10,290  | 金融         |
| INGREDION INC                | 5.3   | 74            | 8,299   | 生活必需品      |
| DUKE ENERGY CORP             | 44.38 | 394           | 44,257  | 公益事業       |
| TARGET CORP                  | 31    | 191           | 21,424  | 一般消費財・サービス |
| DOVER CORP                   | 8.5   | 81            | 9,129   | 資本財・サービス   |
| VWV GRAINGER INC             | 4     | 86            | 9,715   | 資本財・サービス   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 6     | 38            | 4,358   | 資本財・サービス   |
| CINTAS CORP                  | 5.5   | 84            | 9,473   | 資本財・サービス   |
| CA INC                       | 22    | 71            | 8,031   | 情報技術       |
| CONAGRA BRANDS INC           | 25    | 93            | 10,420  | 生活必需品      |
| CLOROX COMPANY               | 9     | 125           | 14,039  | 生活必需品      |
| ENTERGY CORP                 | 11    | 94            | 10,618  | 公益事業       |
| MICROSOFT CORP               | 462.5 | 3,854         | 431,893 | 情報技術       |
| INCYTE CORP                  | 10.5  | 100           | 11,289  | ヘルスケア      |
| CVS HEALTH CORP              | 64.5  | 473           | 53,047  | 生活必需品      |
| MEDTRONIC PLC                | 88.56 | 727           | 81,478  | ヘルスケア      |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 67.5  | 295           | 33,082  | 情報技術       |
| BLACKROCK INC                | 7.6   | 380           | 42,648  | 金融         |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 29    | 86            | 9,641   | 公益事業       |
| HASBRO INC                   | 6     | 55            | 6,241   | 一般消費財・サービス |
| KELLOGG CO                   | 14.5  | 96            | 10,853  | 生活必需品      |
| KEYCORP                      | 71    | 134           | 15,123  | 金融         |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 7.5   | 82            | 9,254   | 資本財・サービス   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 95    | 407           | 45,708  | 生活必需品      |
| KOHL'S CORP                  | 8.5   | 40            | 4,543   | 一般消費財・サービス |
| COOPER COS INC/THE           | 3.5   | 84            | 9,513   | ヘルスケア      |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 23    | 31            | 3,473   | 金融         |
| APACHE CORP                  | 25    | 101           | 11,412  | エネルギー      |
| CHUBB LTD                    | 30.6  | 467           | 52,336  | 金融         |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 4.5   | 36            | 4,049   | 情報技術       |
| ALLSTATE CORP                | 25    | 254           | 28,561  | 金融         |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在      |                    | 業種等        |
|------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|------------|
|                              |                  | 評価額                | 価額                 |            |
|                              |                  | 外貨建金額              | 邦貨換算金額             |            |
|                              | 百株               | 千アメリカ・ドル           | 千円                 |            |
| EBAY INC                     | 66.5             | 228                | 25,617             | 情報技術       |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 70.5             | 516                | 57,864             | 情報技術       |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 9                | 82                 | 9,218              | 素材         |
| XILINX INC                   | 16.5             | 114                | 12,827             | 情報技術       |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 37.85            | 237                | 26,659             | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A          | 15               | 76                 | 8,618              | 一般消費財・サービス |
| ZIONS BANCORPORATION         | 12               | 59                 | 6,654              | 金融         |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 14.5             | 179                | 20,135             | 生活必需品      |
| TOLL BROTHERS INC            | 12               | 60                 | 6,735              | 一般消費財・サービス |
| TRIMBLE INC                  | 13               | 53                 | 6,036              | 情報技術       |
| LENNAR CORP-A                | 14               | 87                 | 9,754              | 一般消費財・サービス |
| LEAR CORP                    | 4                | 71                 | 8,027              | 一般消費財・サービス |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 15               | 71                 | 8,030              | 金融         |
| PROGRESSIVE CORP             | 36.5             | 191                | 21,451             | 金融         |
| PRAXAIR INC                  | 18               | 279                | 31,296             | 素材         |
| PACCAR INC                   | 23               | 158                | 17,784             | 資本財・サービス   |
| PVH CORP                     | 5.5              | 75                 | 8,451              | 一般消費財・サービス |
| BIOGEN INC                   | 13.5             | 431                | 48,399             | ヘルスケア      |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 5.5              | 84                 | 9,490              | ヘルスケア      |
| STARBUCKS CORP               | 88.5             | 508                | 57,029             | 一般消費財・サービス |
| PERRIGO CO PLC               | 9                | 78                 | 8,846              | ヘルスケア      |
| EVERSOURCE ENERGY            | 18.5             | 119                | 13,393             | 公益事業       |
| INTUIT INC                   | 16               | 246                | 27,648             | 情報技術       |
| BORGWARNER INC               | 15.5             | 85                 | 9,527              | 一般消費財・サービス |
| BEST BUY CO INC              | 17               | 100                | 11,206             | 一般消費財・サービス |
| BALL CORP                    | 18.92            | 74                 | 8,386              | 素材         |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 87.5             | 227                | 25,442             | ヘルスケア      |
| BED BATH & BEYOND INC        | 9.5              | 21                 | 2,454              | 一般消費財・サービス |
| XL GROUP LTD                 | 18.5             | 73                 | 8,196              | 金融         |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 19               | 200                | 22,458             | 情報技術       |
| VULCAN MATERIALS CO          | 7.5              | 93                 | 10,492             | 素材         |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 15.2             | 218                | 24,482             | ヘルスケア      |
| VF CORP                      | 21               | 155                | 17,443             | 一般消費財・サービス |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING  | 22               | 124                | 13,937             | 一般消費財・サービス |
| VIACOM INC-CLASS B           | 20               | 56                 | 6,368              | 一般消費財・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 3.5              | 97                 | 10,945             | 一般消費財・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC    | 21               | 34                 | 3,851              | 情報技術       |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 6                | 66                 | 7,477              | ヘルスケア      |
| CARNIVAL CORP                | 24.5             | 160                | 18,036             | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A         | 296              | 1,100              | 123,347            | 一般消費財・サービス |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 11               | 46                 | 5,254              | 資本財・サービス   |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 15               | 97                 | 10,889             | 資本財・サービス   |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 60               | 43                 | 4,860              | 不動産        |
| アメリカ・ドル<br>通 貨 計             | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,375.08<br>599銘柄 | 145,273<br><60.2%> |            |
| (カナダ)                        | 百株               | 千カナダ・ドル            | 千円                 |            |
| IMPERIAL OIL LTD             | 23               | 90                 | 7,921              | エネルギー      |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 1.5              | 113                | 9,865              | 情報技術       |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | 9.38             | 30                 | 2,644              | エネルギー      |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 14.21            | 117                | 10,255             | 一般消費財・サービス |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 22               | 58                 | 5,089              | 素材         |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 10               | 108                | 9,448              | 金融         |

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |        | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|--------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額     |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株     | 千カナダ・ドル       | 千円     |            |
| BCE INC                      | 9      | 55            | 4,835  | 電気通信サービス   |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 11     | 117           | 10,218 | 素材         |
| SUNCOR ENERGY INC            | 107.12 | 475           | 41,407 | エネルギー      |
| METRO INC                    | 16     | 64            | 5,618  | 生活必需品      |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 23     | 146           | 12,777 | 金融         |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 75     | 612           | 53,370 | 金融         |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 29     | 332           | 28,997 | 金融         |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 119    | 893           | 77,788 | 金融         |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 17     | 60            | 5,252  | 金融         |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 92     | 932           | 81,237 | 金融         |
| TOURMALINE OIL CORP          | 13     | 29            | 2,582  | エネルギー      |
| VERMILION ENERGY INC         | 4      | 17            | 1,551  | エネルギー      |
| TRANSCANADA CORP             | 57     | 353           | 30,751 | エネルギー      |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 37.71  | 164           | 14,333 | エネルギー      |
| BOMBARDIER INC-B             | 192    | 56            | 4,933  | 資本財・サービス   |
| BARRICK GOLD CORP            | 83     | 149           | 13,048 | 素材         |
| CAE INC                      | 23     | 51            | 4,517  | 資本財・サービス   |
| THOMSON REUTERS CORP         | 20.2   | 115           | 10,028 | 金融         |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 58     | 145           | 12,669 | 素材         |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 18     | 44            | 3,888  | 生活必需品      |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 6      | 47            | 4,129  | 素材         |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 10     | 59            | 5,217  | 素材         |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 19     | 18            | 1,608  | 金融         |
| LINAMAR CORP                 | 6      | 40            | 3,557  | 一般消費財・サービス |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 11     | 18            | 1,644  | エネルギー      |
| HYDRO ONE LTD                | 15     | 34            | 2,964  | 公益事業       |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 14.89  | 101           | 8,842  | 生活必需品      |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 10     | 38            | 3,362  | 公益事業       |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 22     | 148           | 12,915 | 電気通信サービス   |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 18     | 100           | 8,787  | 素材         |
| KINROSS GOLD CORP            | 105.34 | 56            | 4,936  | 素材         |
| BANK OF MONTREAL             | 41     | 407           | 35,511 | 金融         |
| POWER CORP OF CANADA         | 31     | 101           | 8,864  | 金融         |
| METHANEX CORP                | 6      | 40            | 3,500  | 素材         |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 5      | 66            | 5,809  | 情報技術       |
| CAMECO CORP                  | 28     | 32            | 2,865  | エネルギー      |
| TELUS CORP                   | 3      | 14            | 1,255  | 電気通信サービス   |
| POWER FINANCIAL CORP         | 20     | 71            | 6,187  | 金融         |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 44     | 128           | 11,163 | 素材         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 5      | 81            | 7,094  | 一般消費財・サービス |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 80     | 30            | 2,647  | 素材         |
| AGRIUM INC                   | 9      | 125           | 10,945 | 素材         |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 70     | 299           | 26,089 | エネルギー      |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 2      | 139           | 12,154 | 金融         |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 24     | 170           | 14,829 | 一般消費財・サービス |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 2      | 21            | 1,905  | 生活必需品      |
| BLACKBERRY LTD               | 27     | 36            | 3,221  | 情報技術       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 42     | 213           | 18,616 | 金融         |
| ENBRIDGE INC                 | 105    | 480           | 41,840 | エネルギー      |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 55     | 292           | 25,475 | 金融         |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 125    | 338           | 29,494 | 金融         |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 20     | 42            | 3,698  | ヘルスケア      |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                              | 株数               | 2017年11月30日現在 |                      | 業種等        |
|---------------------------------|------------------|---------------|----------------------|------------|
|                                 |                  | 評価額           | 価額                   |            |
|                                 |                  | 外貨建金額         | 邦貨換算金額               |            |
|                                 | 百株               | 千カナダ・ドル       | 千円                   |            |
| GOLDCORP INC                    | 63               | 102           | 8,922                | 素材         |
| ENCANA CORP                     | 69               | 102           | 8,912                | エネルギー      |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD    | 10               | 222           | 19,405               | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC    | 11               | 65            | 5,666                | 金融         |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC           | 14               | 57            | 4,977                | 一般消費財・サービス |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO        | 48               | 471           | 41,055               | 資本財・サービス   |
| CGI GROUP INC - CLASS A         | 13               | 88            | 7,700                | 情報技術       |
| HUSKY ENERGY INC                | 30.12            | 45            | 4,006                | エネルギー      |
| ONEX CORPORATION                | 7                | 64            | 5,601                | 金融         |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B       | 22               | 63            | 5,560                | 一般消費財・サービス |
| FINNING INTERNATIONAL INC       | 7                | 21            | 1,850                | 資本財・サービス   |
| SNC-LAVALIN GROUP INC           | 9                | 49            | 4,347                | 資本財・サービス   |
| IGM FINANCIAL INC               | 3                | 13            | 1,166                | 金融         |
| OPEN TEXT CORP                  | 14               | 58            | 5,119                | 情報技術       |
| CI FINANCIAL CORP               | 20               | 57            | 4,983                | 金融         |
| SAPUTO INC                      | 13               | 56            | 4,958                | 生活必需品      |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD      | 33               | 47            | 4,170                | 素材         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B      | 25               | 163           | 14,280               | 生活必需品      |
| YAMANA GOLD INC                 | 52               | 17            | 1,539                | 素材         |
| FORTIS INC                      | 30               | 142           | 12,393               | 公益事業       |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP      | 25               | 22            | 1,990                | エネルギー      |
| CENOVUS ENERGY INC              | 80               | 94            | 8,236                | エネルギー      |
| DOLLARAMA INC                   | 6                | 96            | 8,419                | 一般消費財・サービス |
| ATCO LTD -CLASS I               | 8                | 36            | 3,180                | 公益事業       |
| ALTAGAS LTD                     | 8                | 23            | 2,022                | エネルギー      |
| FIRST CAPITAL REALTY INC        | 20               | 41            | 3,630                | 不動産        |
| KEYERA CORP                     | 7                | 25            | 2,180                | エネルギー      |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP    | 7                | 10            | 941                  | エネルギー      |
| INTER PIPELINE LTD              | 20               | 53            | 4,687                | エネルギー      |
| ARC RESOURCES LTD               | 28               | 44            | 3,877                | エネルギー      |
| カナダ・ドル<br>通貨 株数、金額<br>計 銘柄数<比率> | 2,767.47<br>88銘柄 | 11,503        | 1,001,957<br>< 3.7%> |            |
| (オーストラリア)                       | 百株               | 千オーストラリア・ドル   | 千円                   |            |
| HEALTHSCOPE LTD                 | 160              | 31            | 2,668                | ヘルスケア      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD            | 228.24           | 73            | 6,256                | 金融         |
| BHP BILLITON LIMITED            | 206.58           | 570           | 48,459               | 素材         |
| SOUTH32 LTD                     | 362.13           | 121           | 10,295               | 素材         |
| ALUMINA LTD                     | 121              | 27            | 2,372                | 素材         |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD          | 57.74            | 179           | 15,264               | エネルギー      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD      | 105              | 48            | 4,117                | 素材         |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK       | 36               | 41            | 3,495                | 金融         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD     | 172.43           | 510           | 43,287               | 金融         |
| WESTPAC BANKING CORP            | 214.5            | 675           | 57,308               | 金融         |
| SANTOS LTD                      | 96               | 49            | 4,195                | エネルギー      |
| AUST AND NZ BANKING GROUP       | 190.88           | 549           | 46,607               | 金融         |
| RIO TINTO LTD                   | 24.5             | 175           | 14,908               | 素材         |
| ORIGIN ENERGY LTD               | 120.5            | 108           | 9,245                | エネルギー      |
| AMCOR LIMITED                   | 74.96            | 116           | 9,899                | 素材         |
| AURIZON HOLDINGS LTD            | 153.1            | 79            | 6,756                | 資本財・サービス   |
| OIL SEARCH LTD                  | 84               | 59            | 5,040                | エネルギー      |
| SEEK LTD                        | 26               | 48            | 4,126                | 資本財・サービス   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD       | 55.92            | 86            | 7,356                | 生活必需品      |

| 銘柄                                  | 株数              | 2017年11月30日現在 |                    | 業種等        |
|-------------------------------------|-----------------|---------------|--------------------|------------|
|                                     |                 | 評価額           | 価額                 |            |
|                                     |                 | 外貨建金額         | 邦貨換算金額             |            |
|                                     | 百株              | 千オーストラリア・ドル   | 千円                 |            |
| NEWCREST MINING LTD                 | 58.04           | 139           | 11,851             | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD                   | 73              | 29            | 2,465              | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL        | 111.77          | 905           | 76,816             | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD                | 20              | 68            | 5,781              | エネルギー      |
| ORICA LTD                           | 20              | 34            | 2,919              | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD             | 88              | 93            | 7,968              | 金融         |
| CIMIC GROUP LTD                     | 10              | 52            | 4,420              | 資本財・サービス   |
| WOOLWORTHS LTD                      | 76.65           | 206           | 17,538             | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD                | 26              | 20            | 1,712              | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD                | 24              | 11            | 987                | 一般消費財・サービス |
| CROWN RESORTS LTD                   | 30              | 37            | 3,187              | 一般消費財・サービス |
| TELSTRA CORP LTD                    | 206.8           | 70            | 5,949              | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                             | 165.13          | 85            | 7,259              | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI         | 32              | 69            | 5,858              | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD                 | 21.13           | 210           | 17,891             | 金融         |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD              | 40.35           | 95            | 8,081              | 一般消費財・サービス |
| BANK OF QUEENSLAND LTD              | 30              | 39            | 3,317              | 金融         |
| CSL LTD                             | 31.02           | 452           | 38,429             | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD                      | 69.85           | 305           | 25,888             | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                        | 4.44            | 81            | 6,922              | ヘルスケア      |
| BLUESCOPE STEEL LTD                 | 32.12           | 44            | 3,797              | 素材         |
| SUNCORP GROUP LTD                   | 99.38           | 141           | 12,044             | 金融         |
| BORAL LTD                           | 86              | 65            | 5,539              | 素材         |
| ASX LTD                             | 13              | 74            | 6,325              | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD                   | 37              | 61            | 5,193              | 情報技術       |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP           | 175.18          | 126           | 10,749             | 金融         |
| SONIC HEALTHCARE LTD                | 25              | 55            | 4,742              | ヘルスケア      |
| CHALLENGER LTD                      | 25              | 35            | 2,970              | 金融         |
| TATTS GROUP LTD                     | 80              | 34            | 2,946              | 一般消費財・サービス |
| AGL ENERGY LTD                      | 40.5            | 102           | 8,706              | 公益事業       |
| BRAMBLES LTD                        | 113.37          | 116           | 9,862              | 資本財・サービス   |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD              | 9               | 62            | 5,323              | ヘルスケア      |
| REA GROUP LTD                       | 6.08            | 48            | 4,134              | 情報技術       |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L        | 6.21            | 29            | 2,471              | 一般消費財・サービス |
| オーストラリア・ドル<br>通貨 株数、金額<br>計 銘柄数<比率> | 4,375.5<br>53銘柄 | 7,561         | 641,718<br>< 2.4%> |            |
| (香港)                                | 百株              | 千香港ドル         | 千円                 |            |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD           | 90              | 603           | 8,653              | 公益事業       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L        | 170             | 985           | 14,136             | 一般消費財・サービス |
| MTR CORP                            | 75              | 344           | 4,945              | 資本財・サービス   |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES             | 90              | 1,153         | 16,557             | 不動産        |
| SINO LAND CO                        | 120             | 166           | 2,386              | 不動産        |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD           | 195.52          | 1,903         | 27,313             | 資本財・サービス   |
| WHARF HOLDINGS LTD                  | 80              | 196           | 2,818              | 不動産        |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A            | 35              | 263           | 3,781              | 不動産        |
| CLP HOLDINGS LTD                    | 100             | 812           | 11,652             | 公益事業       |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT          | 95.59           | 493           | 7,084              | 不動産        |
| HANG LUNG GROUP LTD                 | 80              | 216           | 3,099              | 不動産        |
| HONG KONG & CHINA GAS               | 510.96          | 780           | 11,203             | 公益事業       |
| HANG SENG BANK LTD                  | 47              | 892           | 12,807             | 金融         |
| WHEELOCK & CO LTD                   | 60              | 319           | 4,589              | 不動産        |
| NEW WORLD DEVELOPMENT               | 320             | 360           | 5,170              | 不動産        |

| 銘柄                               | 2017年11月30日現在    |              |                    | 業 種 等      |
|----------------------------------|------------------|--------------|--------------------|------------|
|                                  | 株 数              | 評 価 額        | 外貨建金額 邦貨換算金額       |            |
| WH GROUP LTD                     | 百株 585           | 千香港ドル 488    | 千円 7,009           | 生活必需品      |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR      | 80               | 1,920        | 27,552             | 金融         |
| LI & FUNG LTD                    | 700              | 242          | 3,475              | 一般消費財・サービス |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD         | 120              | 220          | 3,158              | 不動産        |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY           | 20               | 233          | 3,346              | 情報技術       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG         | 80               | 224          | 3,220              | 一般消費財・サービス |
| NWS HOLDINGS LTD                 | 150              | 207          | 2,979              | 資本財・サービス   |
| KERRY PROPERTIES LTD             | 75               | 258          | 3,713              | 不動産        |
| BANK OF EAST ASIA LTD            | 86               | 288          | 4,140              | 金融         |
| HYSAN DEVELOPMENT CO             | 60               | 240          | 3,444              | 不動産        |
| SJM HOLDINGS LTD                 | 100              | 63           | 909                | 一般消費財・サービス |
| SWIRE PROPERTIES LTD             | 80               | 210          | 3,013              | 不動産        |
| CK ASSET HOLDINGS LTD            | 185.52           | 1,212        | 17,397             | 不動産        |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L     | 55               | 369          | 5,299              | 公益事業       |
| PCCW LTD                         | 600              | 276          | 3,969              | 電気通信サービス   |
| AIA GROUP LTD                    | 778              | 5,130        | 73,628             | 金融         |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT     | 80               | 381          | 5,470              | 不動産        |
| SANDS CHINA LTD                  | 166              | 637          | 9,147              | 一般消費財・サービス |
| SHANGRI-LA ASIA LTD              | 40               | 72           | 1,036              | 一般消費財・サービス |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD     | 120              | 540          | 7,749              | 一般消費財・サービス |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD       | 215              | 836          | 12,001             | 金融         |
| WYNN MACAU LTD                   | 60               | 140          | 2,019              | 一般消費財・サービス |
| 香港ドル 株数、金額<br>通 貨 計 銘柄数<比率>      | 6,504.59<br>37銘柄 | 23,685       | 339,881<br>< 1.3%> |            |
| (シンガポール)                         | 百株               | 千シンガポール・ドル   | 千円                 |            |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD         | 90               | 234          | 19,481             | 金融         |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD           | 108              | 266          | 22,155             | 金融         |
| SINGAPORE AIRLINES LTD           | 20               | 21           | 1,755              | 資本財・サービス   |
| KEPPEL CORP LTD                  | 93               | 71           | 5,964              | 資本財・サービス   |
| UOL GROUP LTD                    | 52               | 45           | 3,802              | 不動産        |
| CITY DEVELOPMENTS LTD            | 10               | 12           | 1,000              | 不動産        |
| CAPITALAND LTD                   | 190              | 66           | 5,563              | 不動産        |
| YANGJUIANG SHIPBUILDING          | 270              | 41           | 3,436              | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD     | 120              | 32           | 2,725              | 一般消費財・サービス |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD     | 9                | 35           | 2,991              | 一般消費財・サービス |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP     | 218              | 268          | 22,306             | 金融         |
| GENTING SINGAPORE PLC            | 450              | 61           | 5,091              | 一般消費財・サービス |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS     | 484              | 181          | 15,058             | 電気通信サービス   |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING       | 141              | 45           | 3,812              | 資本財・サービス   |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD          | 40               | 12           | 1,018              | 資本財・サービス   |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD        | 90               | 3            | 284                | 生活必需品      |
| SATS LTD                         | 77               | 40           | 3,330              | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD           | 69               | 51           | 4,287              | 金融         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD           | 100              | 20           | 1,697              | 資本財・サービス   |
| STARHUB LTD                      | 120              | 34           | 2,875              | 電気通信サービス   |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD         | 158              | 49           | 4,153              | 生活必需品      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L     | 190              | 63           | 5,279              | 不動産        |
| シンガポール・ドル 株数、金額<br>通 貨 計 銘柄数<比率> | 3,099<br>22銘柄    | 1,659        | 138,073<br>< 0.5%> |            |
| (ニュージーランド)                       | 百株               | 千ニュージーランド・ドル | 千円                 |            |
| MERIDIAN ENERGY LTD              | 150              | 42           | 3,278              | 公益事業       |

| 銘柄                                 | 2017年11月30日現在 |       |                   | 業 種 等      |
|------------------------------------|---------------|-------|-------------------|------------|
|                                    | 株 数           | 評 価 額 | 外貨建金額 邦貨換算金額      |            |
| SPARK NEW ZEALAND LTD              | 百株 168.6      | 千円 60 | 4,641             | 電気通信サービス   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD          | 81            | 52    | 4,049             | 資本財・サービス   |
| FLETCHER BUILDING LTD              | 19            | 13    | 997               | 素材         |
| RYMAN HEALTHCARE LTD               | 44.19         | 45    | 3,524             | ヘルスケア      |
| ニュージーランド・ドル 株数、金額<br>通 貨 計 銘柄数<比率> | 462.79<br>5銘柄 | 215   | 16,490<br>< 0.1%> |            |
| (イギリス)                             | 百株            | 千円    |                   |            |
| MERLIN ENTERTAINMENT               | 50            | 17    | 2,675             | 一般消費財・サービス |
| TUI AG-DI                          | 26            | 34    | 5,260             | 一般消費財・サービス |
| BP PLC                             | 1,272.11      | 629   | 94,566            | エネルギー      |
| UNILEVER PLC                       | 80.24         | 338   | 50,855            | 生活必需品      |
| BARCLAYS PLC                       | 1,054.37      | 204   | 30,789            | 金融         |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC           | 107.7         | 92    | 13,940            | 資本財・サービス   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC          | 105           | 32    | 4,931             | 一般消費財・サービス |
| RANDGOLD RESOURCES LTD             | 5             | 34    | 5,197             | 素材         |
| PRUDENTIAL PLC                     | 172.78        | 328   | 49,350            | 金融         |
| INMARSAT PLC                       | 42.34         | 20    | 3,080             | 電気通信サービス   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP       | 236.79        | 66    | 10,024            | 金融         |
| JOHNSON MATTHEY PLC                | 10.3          | 31    | 4,736             | 素材         |
| BAE SYSTEMS PLC                    | 190.5         | 103   | 15,578            | 資本財・サービス   |
| AVIVA PLC                          | 273.06        | 138   | 20,893            | 金融         |
| GLAXOSMITHKLINE PLC                | 323           | 422   | 63,487            | ヘルスケア      |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL          | 31.33         | 78    | 11,765            | 情報技術       |
| WORLDPAY GROUP PLC                 | 135.17        | 56    | 8,493             | 情報技術       |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC       | 29            | 15    | 2,354             | ヘルスケア      |
| AUTO TRADER GROUP PLC              | 42            | 14    | 2,130             | 情報技術       |
| DCC PLC                            | 5             | 36    | 5,441             | 資本財・サービス   |
| CONVATEC GROUP PLC                 | 65.81         | 12    | 1,890             | ヘルスケア      |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL       | 4,954.2       | 0     | 74                | その他        |
| ROYAL MAIL PLC                     | 32.5          | 14    | 2,134             | 資本財・サービス   |
| RELX PLC                           | 66            | 115   | 17,363            | 資本財・サービス   |
| DIAGEO PLC                         | 159.54        | 413   | 62,201            | 生活必需品      |
| RIO TINTO PLC                      | 80.59         | 283   | 42,620            | 素材         |
| STANDARD CHARTERED PLC             | 220.5         | 165   | 24,827            | 金融         |
| TESCO PLC                          | 591.54        | 117   | 17,607            | 生活必需品      |
| FRESNILLO PLC                      | 24            | 31    | 4,701             | 素材         |
| SMITH & NEPHEW PLC                 | 59.67         | 78    | 11,759            | ヘルスケア      |
| GLENCORE PLC                       | 805.44        | 275   | 41,470            | 素材         |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC              | 54.66         | 38    | 5,858             | エネルギー      |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC            | 15            | 23    | 3,603             | 金融         |
| SMITHS GROUP PLC                   | 22.6          | 33    | 5,089             | 資本財・サービス   |
| BABCOCK INTL GROUP PLC             | 6             | 4     | 630               | 資本財・サービス   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP        | 109.63        | 39    | 6,002             | 金融         |
| DIXONS CARPHONE PLC                | 47            | 7     | 1,162             | 一般消費財・サービス |
| PEARSON PLC                        | 43            | 30    | 4,576             | 一般消費財・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC                  | 68.5          | 16    | 2,426             | 生活必需品      |
| NEXT PLC                           | 11.59         | 52    | 7,845             | 一般消費財・サービス |
| TAYLOR WIMPEY PLC                  | 170           | 33    | 5,014             | 一般消費財・サービス |
| WHITBREAD PLC                      | 9.5           | 34    | 5,189             | 一般消費財・サービス |
| IMI PLC                            | 24.1          | 30    | 4,619             | 資本財・サービス   |
| BUNZL PLC                          | 19            | 40    | 6,021             | 資本財・サービス   |

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数       | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|----------|---------------|---------|------------|
|                              |          | 評価額           | 価額      |            |
|                              |          | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株       | 千円            | 千円      |            |
| GKN PLC                      | 92       | 28            | 4,305   | 一般消費財・サービス |
| VODAFONE GROUP PLC           | 1,691.14 | 380           | 57,265  | 電気通信サービス   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 8.03     | 34            | 5,185   | 素材         |
| KINGFISHER PLC               | 172.29   | 57            | 8,715   | 一般消費財・サービス |
| WPP PLC                      | 77       | 100           | 15,163  | 一般消費財・サービス |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 36.9     | 29            | 4,493   | 公益事業       |
| SEVERN TRENT PLC             | 13       | 27            | 4,160   | 公益事業       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 43.64    | 284           | 42,760  | 生活必需品      |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 27       | 32            | 4,919   | 金融         |
| SCHRODERS PLC                | 5.5      | 19            | 2,856   | 金融         |
| TATE & LYLE PLC              | 20       | 13            | 2,008   | 生活必需品      |
| SSE PLC                      | 61.06    | 83            | 12,502  | 公益事業       |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 13       | 26            | 3,916   | 資本財・サービス   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 59       | 35            | 5,401   | 一般消費財・サービス |
| ASTRAZENECA PLC              | 80.08    | 392           | 58,988  | ヘルスケア      |
| FERGUSON PLC                 | 16       | 85            | 12,880  | 資本財・サービス   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 399.29   | 107           | 16,110  | 金融         |
| 3I GROUP PLC                 | 57.37    | 52            | 7,895   | 金融         |
| SKY PLC                      | 63       | 58            | 8,855   | 一般消費財・サービス |
| ASHTED GROUP PLC             | 39       | 75            | 11,309  | 資本財・サービス   |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 58.79    | 45            | 6,884   | 情報技術       |
| NATIONAL GRID PLC            | 228.11   | 200           | 30,176  | 公益事業       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 4,676.86 | 313           | 47,176  | 金融         |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 63.8     | 38            | 5,826   | 金融         |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 61.07    | 186           | 27,964  | 生活必需品      |
| CENTRICA PLC                 | 380.02   | 54            | 8,157   | 公益事業       |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 7        | 26            | 4,042   | 一般消費財・サービス |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | 5.5      | 4             | 731     | 金融         |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 150.57   | 723           | 108,694 | 生活必需品      |
| BHP BILLITON PLC             | 135.12   | 182           | 27,421  | 素材         |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 19.5     | 58            | 8,829   | 生活必需品      |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 1,318.5  | 979           | 147,309 | 金融         |
| SHIRE PLC                    | 56.38    | 209           | 31,499  | ヘルスケア      |
| OLD MUTUAL PLC               | 307.12   | 61            | 9,256   | 金融         |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 91.68    | 126           | 18,964  | 素材         |
| MONDI PLC                    | 34       | 60            | 9,041   | 素材         |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 145      | 31            | 4,760   | 生活必需品      |
| CARNIVAL PLC                 | 13.83    | 67            | 10,102  | 一般消費財・サービス |
| EASYJET PLC                  | 16.44    | 23            | 3,477   | 資本財・サービス   |
| COMPASS GROUP PLC            | 105.61   | 159           | 24,052  | 一般消費財・サービス |
| PERSIMMON PLC                | 25.69    | 66            | 10,006  | 一般消費財・サービス |
| BT GROUP PLC                 | 557.73   | 142           | 21,413  | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 12       | 28            | 4,306   | 生活必需品      |
| BURBERRY GROUP PLC           | 33       | 56            | 8,552   | 一般消費財・サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 13.72    | 60            | 9,027   | 一般消費財・サービス |
| CAPITA PLC                   | 49       | 24            | 3,644   | 資本財・サービス   |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 17       | 26            | 4,053   | 資本財・サービス   |
| INTERTEK GROUP PLC           | 10       | 52            | 7,854   | 資本財・サービス   |
| ITV PLC                      | 275.87   | 43            | 6,569   | 一般消費財・サービス |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 20.35    | 77            | 11,640  | 金融         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 284.55   | 673           | 101,208 | エネルギー      |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 242.47   | 585           | 88,027  | エネルギー      |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在      |                   | 業種等        |
|------------------------------|------------------|--------------------|-------------------|------------|
|                              |                  | 評価額                | 価額                |            |
|                              |                  | 外貨建金額              | 邦貨換算金額            |            |
|                              | 百株               | 千円                 | 千円                |            |
| MEGGITT PLC                  | 35               | 17                 | 2,563             | 資本財・サービス   |
| G4S PLC                      | 113.2            | 29                 | 4,364             | 資本財・サービス   |
| COBHAM PLC                   | 196.77           | 25                 | 3,809             | 資本財・サービス   |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 10               | 10                 | 1,545             | ヘルスケア      |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 15.7             | 30                 | 4,533             | 金融         |
| INVESTEC PLC                 | 46               | 23                 | 3,578             | 金融         |
| ANTOFAGASTA PLC              | 34.6             | 31                 | 4,790             | 素材         |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC   | 204.57           | 87                 | 13,106            | 金融         |
| EXPERIAN PLC                 | 56.18            | 87                 | 13,158            | 資本財・サービス   |
| イギリス・ポンド<br>通貨計              | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 24,954.66<br>105銘柄 | 12,253<br>< 6.8%> |            |
| (イスラエル)                      | 百株               | 千円                 | 千円                |            |
| AZRIELI GROUP LTD            | 5.3              | 98                 | 3,164             | 不動産        |
| FRUTAROM                     | 4.18             | 125                | 4,022             | 素材         |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 50               | 25                 | 819               | 電気通信サービス   |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | 3                | 148                | 4,734             | 資本財・サービス   |
| BANK HAPOLIM BM              | 79               | 188                | 6,038             | 金融         |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 114              | 223                | 7,145             | 金融         |
| NICE LTD                     | 2                | 61                 | 1,952             | 情報技術       |
| イスラエル・シェケル<br>通貨計            | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 257.48<br>7銘柄      | 871<br>< 0.1%>    |            |
| (スイス)                        | 百株               | 千円                 | 千円                |            |
| DUFREY AG-REG                | 1.89             | 26                 | 3,050             | 一般消費財・サービス |
| UBS GROUP AG-REG             | 236.61           | 402                | 45,813            | 金融         |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 0.5              | 32                 | 3,682             | 素材         |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 10.87            | 80                 | 9,174             | 資本財・サービス   |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 44.7             | 1,107              | 126,085           | ヘルスケア      |
| PARGESA HOLDING SA-BR        | 3.89             | 32                 | 3,706             | 金融         |
| SIKA AG-BR                   | 0.14             | 106                | 12,071            | 素材         |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 0.01             | 67                 | 7,709             | 生活必需品      |
| ABB LTD-REG                  | 131.26           | 329                | 37,532            | 資本財・サービス   |
| SWISS RE AG                  | 20.5             | 190                | 21,666            | 金融         |
| NESTLE SA-REG                | 199              | 1,690              | 192,430           | 生活必需品      |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 1.05             | 70                 | 8,007             | 金融         |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 3                | 66                 | 7,598             | 資本財・サービス   |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 161.81           | 264                | 30,096            | 金融         |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 15.65            | 89                 | 10,172            | 金融         |
| SGS SA-REG                   | 0.32             | 76                 | 8,749             | 資本財・サービス   |
| VIFOR PHARMA AG              | 3.69             | 45                 | 5,204             | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 1.8              | 64                 | 7,337             | 一般消費財・サービス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 9.37             | 276                | 31,528            | 金融         |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 3.2              | 48                 | 5,503             | 金融         |
| NOVARTIS AG-REG              | 142.95           | 1,196              | 136,196           | ヘルスケア      |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 0.2              | 36                 | 4,106             | 生活必需品      |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 34.68            | 292                | 33,238            | 一般消費財・サービス |
| SWISSCOM AG-REG              | 1.8              | 92                 | 10,562            | 電気通信サービス   |
| GEBERIT AG-REG               | 2.34             | 99                 | 11,360            | 資本財・サービス   |
| GIVAUDAN-REG                 | 0.68             | 150                | 17,145            | 素材         |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 0.52             | 37                 | 4,306             | ヘルスケア      |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 3                | 46                 | 5,269             | ヘルスケア      |
| LONZA GROUP AG-REG           | 5.42             | 137                | 15,707            | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 4.5              | 31                 | 3,549             | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           | 株数                  | 2017年11月30日現在  |                    | 業種等        |
|------------------------------|---------------------|----------------|--------------------|------------|
|                              |                     | 評価額            | 価額                 |            |
| 株数                           | 外貨建金額               | 邦貨換算金額         |                    |            |
| 百株                           | 千スイス・フラン            | 千円             |                    |            |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 31.17               | 168            | 19,159             | 素材         |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 2.31                | 76             | 8,672              | 金融         |
| KUEHN + NAGEL INTL AG-REG    | 3                   | 51             | 5,842              | 資本財・サービス   |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 4.5                 | 38             | 4,341              | 不動産        |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 0.03                | 17             | 1,949              | 生活必需品      |
| スイス・フラン<br>通 貨 計             | 1,086.36<br>銘柄数<比率> | 7,542<br>35銘柄  | 85,530<br>< 3.2%>  |            |
| (デンマーク)                      |                     |                |                    |            |
| 百株                           | 千デンマーク・クローネ         | 千円             |                    |            |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 123.55              | 3,978          | 70,973             | ヘルスケア      |
| DANSKE BANK A/S              | 47.44               | 1,127          | 20,117             | 金融         |
| ISS A/S                      | 13.2                | 307            | 5,489              | 資本財・サービス   |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 0.3                 | 314            | 5,608              | 資本財・サービス   |
| H LUNDBECK A/S               | 5                   | 154            | 2,761              | ヘルスケア      |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 13.38               | 524            | 9,354              | 資本財・サービス   |
| TDC A/S                      | 68                  | 255            | 4,566              | 電気通信サービス   |
| CARLSBERG AS-B               | 8.06                | 590            | 10,539             | 生活必需品      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 11.05               | 367            | 6,560              | 素材         |
| COLOPLAST-B                  | 6.5                 | 319            | 5,693              | ヘルスケア      |
| DSV A/S                      | 12                  | 573            | 10,233             | 資本財・サービス   |
| WILLIAM DEMANT HOLDING       | 13.14               | 227            | 4,053              | ヘルスケア      |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 0.43                | 468            | 8,361              | 資本財・サービス   |
| PANDORA A/S                  | 7.5                 | 456            | 8,135              | 一般消費財・サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | 7.5                 | 414            | 7,385              | 素材         |
| GENMAB A/S                   | 4.33                | 519            | 9,269              | ヘルスケア      |
| ORSTED A/S                   | 8.71                | 309            | 5,527              | 公益事業       |
| デンマーク・クローネ<br>通 貨 計          | 350.09<br>銘柄数<比率>   | 10,909<br>17銘柄 | 194,630<br>< 0.7%> |            |
| (ノルウェー)                      |                     |                |                    |            |
| 百株                           | 千ノルウェー・クローネ         | 千円             |                    |            |
| NORSK HYDRO ASA              | 74.5                | 441            | 5,989              | 素材         |
| DNB ASA                      | 62.45               | 946            | 12,856             | 金融         |
| ORKLA ASA                    | 70                  | 581            | 7,889              | 生活必需品      |
| TELENOR ASA                  | 46                  | 846            | 11,494             | 電気通信サービス   |
| STATOIL ASA                  | 76.17               | 1,268          | 17,222             | エネルギー      |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 8.5                 | 316            | 4,300              | 素材         |
| MARINE HARVEST               | 23.5                | 332            | 4,522              | 生活必需品      |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 20                  | 304            | 4,136              | 金融         |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          | 17                  | 356            | 4,836              | 一般消費財・サービス |
| ノルウェー・クローネ<br>通 貨 計          | 398.12<br>銘柄数<比率>   | 5,393<br>9銘柄   | 73,248<br>< 0.3%>  |            |
| (スウェーデン)                     |                     |                |                    |            |
| 百株                           | 千スウェーデン・クローネ        | 千円             |                    |            |
| ICA GRUPPEN AB               | 7                   | 211            | 2,824              | 生活必需品      |
| ERICSSON LM-B SHS            | 207                 | 1,101          | 14,734             | 情報技術       |
| VOLVO AB-B SHS               | 101.88              | 1,612          | 21,578             | 資本財・サービス   |
| MILICOM INTL CELLULAR-SDR    | 2                   | 107            | 1,434              | 電気通信サービス   |
| SKF AB-B SHARES              | 21                  | 405            | 5,425              | 資本財・サービス   |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 15                  | 410            | 5,491              | 一般消費財・サービス |
| NORDEA BANK AB               | 196.49              | 1,927          | 25,790             | 金融         |
| SWEDISH MATCH AB             | 12                  | 377            | 5,054              | 生活必需品      |
| TELE2 AB-B SHS               | 32.58               | 349            | 4,673              | 電気通信サービス   |
| GETINGE AB-B SHS             | 19                  | 289            | 3,879              | ヘルスケア      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 96                  | 948            | 12,690             | 金融         |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在     |                | 業種等        |
|------------------------------|------------------|-------------------|----------------|------------|
|                              |                  | 評価額               | 価額             |            |
| 株数                           | 外貨建金額            | 邦貨換算金額            |                |            |
| 百株                           | 千スウェーデン・クローネ     | 千円                |                |            |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 100              | 1,144             | 15,306         | 金融         |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 55               | 1,096             | 14,666         | 金融         |
| HENNES + MAURITZ AB-B SHS    | 66.23            | 1,290             | 17,262         | 一般消費財・サービス |
| SKANSKA AB-B SHS             | 18               | 328               | 4,390          | 資本財・サービス   |
| SANDVIK AB                   | 81.22            | 1,180             | 15,800         | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            | 25.84            | 1,018             | 13,622         | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 40.41            | 1,473             | 19,718         | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           | 25               | 364               | 4,880          | 資本財・サービス   |
| TELIA CO AB                  | 158              | 579               | 7,758          | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                | 20               | 399               | 5,349          | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 25               | 817               | 10,931         | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              | 67.9             | 1,163             | 15,562         | 資本財・サービス   |
| LUNDBERGS AB-B SHS           | 4.74             | 294               | 3,935          | 金融         |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 19               | 369               | 4,944          | エネルギー      |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 36.5             | 885               | 11,842         | 生活必需品      |
| BOLIDEN AB                   | 18               | 483               | 6,471          | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 24               | 184               | 2,464          | 一般消費財・サービス |
| KINNEVIK AB - B              | 15               | 403               | 5,392          | 金融         |
| HEXAGON AB-B SHS             | 17               | 698               | 9,348          | 情報技術       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 13               | 265               | 3,551          | 金融         |
| スウェーデン・クローネ<br>通 貨 計         | 1,539.79<br>31銘柄 | 22,180<br>< 1.1%> | 296,780        |            |
| ユーロ (アイルランド)                 |                  |                   |                |            |
| 百株                           | 千ユーロ             | 千円                |                |            |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC    | 52.34            | 34                | 4,573          | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            | 12.66            | 110               | 14,730         | 生活必需品      |
| CRH PLC                      | 50.5             | 150               | 19,939         | 素材         |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      | 4.6              | 44                | 5,847          | 一般消費財・サービス |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 120.1<br>4銘柄      | 339<br>< 0.2%> | 45,091     |
| ユーロ (オランダ)                   |                  |                   |                |            |
| 百株                           | 千ユーロ             | 千円                |                |            |
| QIAGEN N.V.                  | 12.99            | 34                | 4,631          | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 59.5             | 192               | 25,630         | ヘルスケア      |
| NN GROUP NV                  | 22.5             | 80                | 10,730         | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              | 106.44           | 520               | 69,069         | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  | 14.9             | 127               | 16,917         | 生活必需品      |
| RELX NV                      | 64               | 124               | 16,532         | 資本財・サービス   |
| AEGON NV                     | 143.61           | 75                | 10,030         | 金融         |
| KONINKLIJKE Ahold delhaize N | 76.26            | 133               | 17,683         | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                   | 17.25            | 130               | 17,335         | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 10.5             | 82                | 10,952         | 素材         |
| WOLTERS KLUWER               | 23.76            | 103               | 13,691         | 資本財・サービス   |
| BOSKALIS WESTMINSTER         | 9.1              | 28                | 3,737          | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV                 | 242.18           | 371               | 49,371         | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 239              | 72                | 9,687          | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV              | 23.06            | 341               | 45,311         | 情報技術       |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        | 24               | 59                | 7,896          | 金融         |
| VOPAK                        | 6.3              | 22                | 2,935          | エネルギー      |
| RANDSTAD HOLDING NV          | 7.5              | 38                | 5,103          | 資本財・サービス   |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 6                | 48                | 6,431          | 生活必需品      |
| GEMALTO                      | 7                | 22                | 2,945          | 情報技術       |
| ALTICE NV - A                | 33.5             | 23                | 3,127          | 一般消費財・サービス |

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在    |                             | 業種等        |
|------------------------------|------------------|------------------|-----------------------------|------------|
|                              |                  | 評価額              | 価額                          |            |
|                              |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                      |            |
| ALTICE NV - B                | 15               | 10               | 1,404                       | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS SE                    | 35.97            | 313              | 41,699                      | 資本財・サービス   |
| EXOR NV                      | 4.5              | 23               | 3,077                       | 金融         |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 73.53            | 79               | 10,595                      | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 70.44            | 101              | 13,527                      | 一般消費財・サービス |
| FERRARI NV                   | 8.3              | 77               | 10,235                      | 一般消費財・サービス |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,357.09<br>27銘柄 | 3,239<br>430,296<br>< 1.6%> |            |
| ユーロ (ベルギー)                   | 百株               | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| UCB SA                       | 7                | 45               | 5,997                       | ヘルスケア      |
| KBC GROEP NV                 | 17.34            | 119              | 15,844                      | 金融         |
| COLRUYT SA                   | 3.5              | 15               | 2,052                       | 生活必需品      |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 4                | 35               | 4,770                       | 金融         |
| SOLVAY SA                    | 5.36             | 63               | 8,375                       | 素材         |
| UMICORE                      | 16               | 62               | 8,279                       | 素材         |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 49.65            | 485              | 64,522                      | 生活必需品      |
| AGEAS                        | 8.78             | 36               | 4,790                       | 金融         |
| PROXIMUS                     | 7                | 19               | 2,656                       | 電気通信サービス   |
| TELENET GROUP HOLDING NV     | 4.62             | 26               | 3,572                       | 一般消費財・サービス |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 123.25<br>10銘柄   | 910<br>120,860<br>< 0.4%>   |            |
| ユーロ (ルクセンブルグ)                | 百株               | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| RTL GROUP                    | 3.5              | 22               | 3,047                       | 一般消費財・サービス |
| ARCELOMITTAL                 | 43.44            | 111              | 14,829                      | 素材         |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 0.6              | 30               | 4,038                       | ヘルスケア      |
| SES                          | 19               | 25               | 3,385                       | 一般消費財・サービス |
| TENARIS SA                   | 22               | 26               | 3,544                       | エネルギー      |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 88.54<br>5銘柄     | 217<br>28,845<br>< 0.1%>    |            |
| ユーロ (フランス)                   | 百株               | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| JCDECAUX SA                  | 8.45             | 29               | 3,879                       | 一般消費財・サービス |
| TOTAL SA                     | 152.31           | 726              | 96,499                      | エネルギー      |
| MICHELIN (CGDE)              | 11.5             | 140              | 18,679                      | 一般消費財・サービス |
| AIR LIQUIDE SA               | 28.45            | 299              | 39,824                      | 素材         |
| KERING                       | 5.12             | 192              | 25,560                      | 一般消費財・サービス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 34.29            | 248              | 33,012                      | 資本財・サービス   |
| BOUYGUES SA                  | 12.5             | 53               | 7,170                       | 資本財・サービス   |
| BNP PARIBAS                  | 70.25            | 451              | 59,981                      | 金融         |
| PEUGEOT SA                   | 28.73            | 49               | 6,599                       | 一般消費財・サービス |
| NATIXIS                      | 76.74            | 51               | 6,814                       | 金融         |
| THALES SA                    | 6                | 50               | 6,693                       | 資本財・サービス   |
| DANONE                       | 39.26            | 280              | 37,244                      | 生活必需品      |
| CARREFOUR SA                 | 33.1             | 58               | 7,816                       | 生活必需品      |
| SUEZ                         | 29.5             | 46               | 6,115                       | 公益事業       |
| VIVENDI                      | 69.25            | 157              | 20,886                      | 一般消費財・サービス |
| L'OREAL                      | 15.5             | 289              | 38,484                      | 生活必需品      |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 32.89            | 159              | 21,191                      | 資本財・サービス   |
| LEGRAND SA                   | 17.5             | 109              | 14,551                      | 資本財・サービス   |
| CASINO GUICHARD PERRACHON    | 2                | 10               | 1,359                       | 生活必需品      |
| PERNOD RICARD SA             | 13.03            | 170              | 22,600                      | 生活必需品      |
| SOCIETE BIC SA               | 1.5              | 14               | 1,897                       | 資本財・サービス   |
| EURAZEO SA                   | 1.59             | 11               | 1,538                       | 金融         |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在    |                               | 業種等        |
|------------------------------|------------------|------------------|-------------------------------|------------|
|                              |                  | 評価額              | 価額                            |            |
|                              |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                        |            |
| REXEL SA                     | 16               | 24               | 3,300                         | 資本財・サービス   |
| SOCIETE GENERALE SA          | 46.26            | 198              | 26,353                        | 金融         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 17.1             | 419              | 55,663                        | 一般消費財・サービス |
| ACCOR SA                     | 10               | 42               | 5,600                         | 一般消費財・サービス |
| CAPGEMINI SE                 | 9.3              | 90               | 12,030                        | 情報技術       |
| VALEO SA                     | 15.12            | 91               | 12,199                        | 一般消費財・サービス |
| PUBLICIS GROUPE              | 13               | 72               | 9,668                         | 一般消費財・サービス |
| BUREAU VERITAS SA            | 17               | 37               | 5,024                         | 資本財・サービス   |
| EIFFAGE                      | 4                | 36               | 4,913                         | 資本財・サービス   |
| SODEXO SA                    | 6.69             | 73               | 9,746                         | 一般消費財・サービス |
| IPSEN                        | 2.76             | 28               | 3,793                         | ヘルスケア      |
| INGENICO GROUP               | 4.99             | 43               | 5,745                         | 情報技術       |
| ZODIAC AEROSPACE             | 8                | 19               | 2,622                         | 資本財・サービス   |
| SEB SA                       | 1.97             | 30               | 4,106                         | 一般消費財・サービス |
| ESSILOR INTERNATIONAL        | 11.9             | 126              | 16,863                        | ヘルスケア      |
| DASSAULT AVIATION SA         | 0.22             | 28               | 3,792                         | 資本財・サービス   |
| AXA SA                       | 123.65           | 315              | 41,908                        | 金融         |
| LAGARDERE SCA                | 12               | 32               | 4,347                         | 一般消費財・サービス |
| EDENRED                      | 19.13            | 46               | 6,162                         | 資本財・サービス   |
| RENAULT SA                   | 12               | 102              | 13,672                        | 一般消費財・サービス |
| HERMES INTERNATIONAL         | 2.04             | 89               | 11,834                        | 一般消費財・サービス |
| REMY COINTREAU               | 2.53             | 27               | 3,714                         | 生活必需品      |
| ATOS SE                      | 6.43             | 79               | 10,550                        | 情報技術       |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 8.99             | 80               | 10,637                        | 情報技術       |
| WENDEL                       | 2.01             | 28               | 3,747                         | 金融         |
| ORANGE                       | 121.29           | 175              | 23,292                        | 電気通信サービス   |
| ALSTOM                       | 13.1             | 45               | 6,023                         | 資本財・サービス   |
| CNP ASSURANCES               | 13.49            | 25               | 3,391                         | 金融         |
| SANOFI                       | 72.79            | 560              | 74,418                        | ヘルスケア      |
| VINCI SA                     | 31.06            | 269              | 35,846                        | 資本財・サービス   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 23.63            | 50               | 6,686                         | 公益事業       |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 76.58            | 108              | 14,421                        | 金融         |
| ENGIE                        | 123.26           | 182              | 24,227                        | 公益事業       |
| IMERYS SA                    | 3.4              | 26               | 3,472                         | 素材         |
| EDF                          | 34               | 38               | 5,102                         | 公益事業       |
| SAFRAN SA                    | 18.5             | 167              | 22,218                        | 資本財・サービス   |
| ILIAD SA                     | 2.19             | 43               | 5,732                         | 電気通信サービス   |
| ARKEMA                       | 4.8              | 49               | 6,531                         | 素材         |
| ADP                          | 1                | 15               | 2,109                         | 資本財・サービス   |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 14               | 26               | 3,523                         | 一般消費財・サービス |
| SCOR SE                      | 12.97            | 44               | 5,945                         | 金融         |
| GROUPE EURO TUNNEL SE - REGR | 39.4             | 43               | 5,763                         | 資本財・サービス   |
| BOLLORE                      | 73               | 32               | 4,314                         | 資本財・サービス   |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,741.01<br>65銘柄 | 7,675<br>1,019,425<br>< 3.8%> |            |
| ユーロ (ドイツ)                    | 百株               | 千ユーロ             | 千円                            |            |
| BAYER AG-REG                 | 53.6             | 579              | 76,916                        | ヘルスケア      |
| EVONIK INDUSTRIES AG         | 6                | 18               | 2,477                         | 素材         |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 136.93           | 220              | 29,224                        | 金融         |
| COMMERZBANK AG               | 72.89            | 88               | 11,747                        | 金融         |
| VOLKSWAGEN AG                | 2.2              | 37               | 5,022                         | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 11.72            | 207              | 27,503                        | 一般消費財・サービス |

| 銘 柄                                                      | 2017年11月30日現在    |                  |                  | 業 種 等      |
|----------------------------------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------|
|                                                          | 株 数              | 評 価 額            | 外貨建金額 邦貨換算金額     |            |
|                                                          | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| MAN SE                                                   | 1                | 9                | 1,257            | 資本財・サービス   |
| SIEMENS AG-REG                                           | 49.62            | 568              | 75,455           | 資本財・サービス   |
| E.ON SE                                                  | 128.43           | 126              | 16,799           | 公益事業       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG                              | 19.96            | 169              | 22,460           | 一般消費財・サービス |
| GEA GROUP AG                                             | 13               | 52               | 6,945            | 資本財・サービス   |
| OSRAM LIGHT AG                                           | 6.45             | 45               | 6,004            | 資本財・サービス   |
| CONTINENTAL AG                                           | 7.5              | 164              | 21,878           | 一般消費財・サービス |
| BASF SE                                                  | 57.14            | 535              | 71,053           | 素材         |
| K+S AG-REG                                               | 14               | 27               | 3,666            | 素材         |
| ALLIANZ SE-REG                                           | 28.61            | 572              | 76,031           | 金融         |
| THYSENKRUPP AG                                           | 26.3             | 60               | 8,094            | 素材         |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG                               | 11.2             | 127              | 16,919           | 生活必需品      |
| RWVE AG                                                  | 33.07            | 64               | 8,621            | 公益事業       |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                                   | 17               | 48               | 6,477            | 資本財・サービス   |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT                             | 1.1              | 9                | 1,227            | 資本財・サービス   |
| BRENNTAG AG                                              | 8                | 41               | 5,547            | 資本財・サービス   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA                                   | 25.42            | 153              | 20,451           | ヘルスケア      |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE                             | 9.59             | 52               | 7,017            | 情報技術       |
| HOCHTIEF AG                                              | 1.66             | 24               | 3,232            | 資本財・サービス   |
| SAP SE                                                   | 64.24            | 612              | 81,341           | 情報技術       |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG                               | 10.36            | 199              | 26,445           | 金融         |
| SCHAEFFLER AG                                            | 21.02            | 30               | 4,068            | 一般消費財・サービス |
| ZALANDO SE                                               | 7                | 30               | 3,997            | 一般消費財・サービス |
| HEIDELBERGCEMENT AG                                      | 9                | 80               | 10,660           | 素材         |
| KION GROUP AG                                            | 6                | 41               | 5,506            | 資本財・サービス   |
| COVESTRO AG                                              | 8.03             | 69               | 9,277            | 素材         |
| INNOGY SE                                                | 6                | 23               | 3,131            | 公益事業       |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF                               | 8                | 56               | 7,532            | 一般消費財・サービス |
| METRO AG                                                 | 15               | 24               | 3,250            | 生活必需品      |
| LINDE AG - TENDER                                        | 11.63            | 228              | 30,320           | 素材         |
| BEIERSDORF AG                                            | 8.15             | 80               | 10,648           | 生活必需品      |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF                                  | 7                | 30               | 4,071            | 素材         |
| MERCK KGAA                                               | 8.12             | 73               | 9,757            | ヘルスケア      |
| ADIDAS AG                                                | 12.57            | 223              | 29,657           | 一般消費財・サービス |
| HENKEL AG & CO KGAA                                      | 6.5              | 66               | 8,844            | 生活必需品      |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG                                  | 211.13           | 312              | 41,527           | 電気通信サービス   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAWMLER AG-REGISTERED SHARES | 13.67            | 113              | 15,046           | ヘルスケア      |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG                                 | 60.01            | 420              | 55,893           | 一般消費財・サービス |
| HANNOVER RUECK SE                                        | 70.1             | 162              | 21,617           | 情報技術       |
| DEUTSCHE POST AG-REG                                     | 3.5              | 38               | 5,157            | 金融         |
| DEUTSCHE BOERSE AG                                       | 58.59            | 233              | 31,004           | 資本財・サービス   |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE                                  | 12.74            | 120              | 15,977           | 金融         |
| LANXESS AG                                               | 15.6             | 42               | 5,610            | 一般消費財・サービス |
| AXEL SPRINGER SE                                         | 6                | 37               | 5,039            | 素材         |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                                       | 4.7              | 30               | 4,114            | 一般消費財・サービス |
| SYMRSE AG                                                | 23.63            | 86               | 11,534           | 不動産        |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI                             | 8.3              | 58               | 7,762            | 素材         |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF                             | 62.4             | 24               | 3,298            | 電気通信サービス   |
| HUGO BOSS AG -ORD                                        | 2.5              | 18               | 2,420            | 一般消費財・サービス |
| VONOVIA SE                                               | 3.5              | 24               | 3,200            | 一般消費財・サービス |
|                                                          | 27.6             | 107              | 14,304           | 不動産        |
| 国 小 計                                                    | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,534.98<br>57銘柄 | 7,710<br>< 3.8%> | 1,024,060  |

| 銘 柄                          | 2017年11月30日現在    |                  |                  | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------|
|                              | 株 数              | 評 価 額            | 外貨建金額 邦貨換算金額     |            |
|                              | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| ユーロ (ポルトガル)                  | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| JERONIMO MARTINS             | 8                | 13               | 1,772            | 生活必需品      |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 151              | 43               | 5,831            | 公益事業       |
| GALP ENERGIA SGPS SA         | 36.09            | 57               | 7,671            | エネルギー      |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 195.09<br>3銘柄    | 115<br>< 0.1%>   | 15,275     |
| ユーロ (スペイン)                   | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| TELEFONICA SA                | 278.32           | 241              | 32,017           | 電気通信サービス   |
| ENDESA SA                    | 21.5             | 40               | 5,422            | 公益事業       |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 424.92           | 309              | 41,078           | 金融         |
| IBERDROLA SA                 | 368.4            | 245              | 32,658           | 公益事業       |
| BANCO DE SABADELL SA         | 325.87           | 55               | 7,405            | 金融         |
| BANKINTER SA                 | 67               | 54               | 7,192            | 金融         |
| REPSOL SA                    | 83.17            | 128              | 17,032           | エネルギー      |
| GRIFOLS SA                   | 17               | 41               | 5,543            | ヘルスケア      |
| BANCO SANTANDER SA           | 1,025.73         | 585              | 77,703           | 金融         |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA  | 48.29            | 89               | 11,941           | 資本財・サービス   |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 26.68            | 162              | 21,625           | 情報技術       |
| GAS NATURAL SDG SA           | 21               | 39               | 5,257            | 公益事業       |
| MAPFRE SA                    | 80.05            | 22               | 3,036            | 金融         |
| CAIXABANK S.A                | 219.87           | 88               | 11,814           | 金融         |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 49               | 34               | 4,515            | 資本財・サービス   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 12               | 39               | 5,229            | 資本財・サービス   |
| AENA SME SA                  | 4                | 67               | 8,999            | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 69.28            | 206              | 27,396           | 一般消費財・サービス |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 17.93            | 18               | 2,514            | 資本財・サービス   |
| ENAGAS SA                    | 18.59            | 45               | 6,035            | エネルギー      |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 23               | 43               | 5,783            | 公益事業       |
| FERROVIAL SA                 | 38.76            | 71               | 9,523            | 資本財・サービス   |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL  | 32               | 12               | 1,678            | 生活必需品      |
| BANKIA SA                    | 72.87            | 29               | 3,913            | 金融         |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,345.23<br>24銘柄 | 2,675<br>< 1.3%> | 355,321    |
| ユーロ (イタリア)                   | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA  | 130              | 24               | 3,313            | 金融         |
| PRYSMIAN SPA                 | 14.4             | 40               | 5,324            | 資本財・サービス   |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 75.23            | 114              | 15,196           | 金融         |
| SAIPEM SPA                   | 71.63            | 24               | 3,310            | エネルギー      |
| MEDIOBANCA SPA               | 44.6             | 42               | 5,633            | 金融         |
| UNICREDIT SPA                | 123.35           | 210              | 27,915           | 金融         |
| TELECOM ITALIA SPA           | 613              | 42               | 5,702            | 電気通信サービス   |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 483.81           | 27               | 3,685            | 電気通信サービス   |
| INTESA SANPAOLO-RSP          | 93.84            | 24               | 3,315            | 金融         |
| INTESA SANPAOLO              | 837.01           | 236              | 31,348           | 金融         |
| ATLANTIA SPA                 | 26.77            | 74               | 9,848            | 資本財・サービス   |
| POSTE ITALIANE SPA           | 29               | 17               | 2,366            | 金融         |
| RECORDATI SPA                | 6.92             | 26               | 3,457            | ヘルスケア      |
| ENI SPA                      | 163.64           | 225              | 29,904           | エネルギー      |
| LEONARDO SPA                 | 25               | 25               | 3,330            | 資本財・サービス   |
| ENEL SPA                     | 501.29           | 274              | 36,450           | 公益事業       |
| SNAM SPA                     | 162              | 68               | 9,100            | エネルギー      |
| LUXOTTICA GROUP SPA          | 13.07            | 62               | 8,338            | 一般消費財・サービス |

| 銘                            | 柄                | 2017年11月30日現在        |            |                       | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|----------------------|------------|-----------------------|------------|
|                              |                  | 株 数                  | 評 価 額      | 業 種 等                 |            |
|                              |                  | 株 数                  | 外貨建金額      | 邦貨換算金額                |            |
| TERNA SPA                    |                  | 百株<br>99             | 千ユーロ<br>51 | 千円<br>6,817           | 公益事業       |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,513.56<br>19銘柄     | 1,614      | 214,359<br>< 0.8%>    |            |
| ユーロ（フィンランド）                  |                  | 百株                   | 千ユーロ       | 千円                    |            |
| UPM-KYMMENE OYJ              |                  | 31.7                 | 81         | 10,807                | 素材         |
| NOKIA OYJ                    |                  | 364.94               | 153        | 20,404                | 情報技術       |
| WARTSILA OYJ ABP             |                  | 8.5                  | 47         | 6,254                 | 資本財・サービス   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |                  | 41.93                | 54         | 7,272                 | 素材         |
| METSO OYJ                    |                  | 11.08                | 32         | 4,382                 | 資本財・サービス   |
| ELISA OYJ                    |                  | 13                   | 44         | 5,858                 | 電気通信サービス   |
| SAMPO OYJ-A SHS              |                  | 29.29                | 130        | 17,341                | 金融         |
| FORTUM OYJ                   |                  | 24                   | 42         | 5,587                 | 公益事業       |
| KONE OYJ-B                   |                  | 19.28                | 83         | 11,141                | 資本財・サービス   |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           |                  | 7                    | 25         | 3,390                 | 一般消費財・サービス |
| NESTE OYJ                    |                  | 11                   | 55         | 7,392                 | エネルギー      |
| ORION OYJ-CLASS B            |                  | 5                    | 16         | 2,146                 | ヘルスケア      |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 566.72<br>12銘柄       | 767        | 101,978<br>< 0.4%>    |            |
| ユーロ（オーストリア）                  |                  | 百株                   | 千ユーロ       | 千円                    |            |
| OMV AG                       |                  | 6                    | 31         | 4,153                 | エネルギー      |
| ERSTE GROUP BANK AG          |                  | 20                   | 73         | 9,704                 | 金融         |
| VOESTALPINE AG               |                  | 8                    | 39         | 5,208                 | 素材         |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA |                  | 11                   | 33         | 4,411                 | 金融         |
| ANDRITZ AG                   |                  | 5.5                  | 25         | 3,386                 | 資本財・サービス   |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 50.5<br>5銘柄          | 202        | 26,864<br>< 0.1%>     |            |
| ユーロ（その他）                     |                  | 百株                   | 千ユーロ       | 千円                    |            |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  |                  | 13                   | 42         | 5,588                 | 生活必需品      |
| STMICROELECTRONICS NV        |                  | 33.17                | 62         | 8,301                 | 情報技術       |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 46.17<br>2銘柄         | 104        | 13,890<br>< 0.1%>     |            |
| ユーロ通貨計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12,682.24<br>233銘柄   | 25,572     | 3,396,269<br><12.6%>  |            |
| ファンド合計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 77,853.17<br>1,241銘柄 | —          | 25,105,407<br><92.9%> |            |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託受益証券

| 銘                            | 柄       | 2017年11月30日現在 |          |        |
|------------------------------|---------|---------------|----------|--------|
|                              |         | □ 数           | 評 価 額    | 業 種 等  |
|                              |         | □ 数           | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |
| (シンガポール)                     |         | 千□            | 千アメリカ・ドル | 千円     |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U |         | 70            | 29       | 3,294  |
| アメリカ・ドル                      | □ 数、金額  | 70            | 29       | 3,294  |
| 通 貨 計                        | 銘柄数<比率> | 1銘柄           |          | <0.0%> |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

| 銘柄                           | 2017年11月30日現在     |                |                 |
|------------------------------|-------------------|----------------|-----------------|
|                              | □ 数               | 評価額            |                 |
|                              |                   | 外貨建金額          | 邦貨換算金額          |
| (アメリカ)                       | 千口                | 千アメリカ・ドル       | 千円              |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 0.872             | 158            | 17,786          |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 1.894             | 300            | 33,686          |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.85              | 106            | 11,910          |
| GGP INC                      | 4                 | 93             | 10,487          |
| VORNADO REALTY TRUST         | 1.156             | 88             | 9,964           |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 0.8               | 135            | 15,217          |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 2.25              | 150            | 16,825          |
| EQUINIX INC                  | 0.514             | 240            | 26,972          |
| AMERICAN TOWER CORP          | 2.8               | 409            | 45,900          |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 4.228             | 83             | 9,318           |
| KIMCO REALTY CORP            | 3.3               | 60             | 6,829           |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 3.5               | 43             | 4,823           |
| VENTAS INC                   | 2.1               | 134            | 15,075          |
| WEYERHAEUSER CO              | 4.904             | 173            | 19,435          |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 2.1               | 42             | 4,722           |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 1.4               | 25             | 2,861           |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 2.5               | 282            | 31,614          |
| IRON MOUNTAIN INC            | 1.718             | 69             | 7,800           |
| VEREIT INC                   | 7.75              | 60             | 6,816           |
| PROLOGIS INC                 | 3.415             | 225            | 25,304          |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 0.7               | 88             | 9,958           |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 0.65              | 59             | 6,670           |
| DUKE REALTY CORP             | 1.8               | 51             | 5,778           |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.45              | 111            | 12,488          |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 0.45              | 59             | 6,660           |
| WELLTOWER INC                | 2.35              | 158            | 17,716          |
| HCP INC                      | 2.8               | 75             | 8,439           |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 1                 | 44             | 4,999           |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 0.7               | 71             | 8,019           |
| MACERICH CO/THE              | 0.7               | 44             | 5,037           |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 6.3               | 74             | 8,308           |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 0.65              | 26             | 3,013           |
| REALTY INCOME CORP           | 1.8               | 99             | 11,187          |
| PUBLIC STORAGE               | 0.95              | 199            | 22,381          |
| REGENCY CENTERS CORP         | 1.15              | 78             | 8,762           |
| SL GREEN REALTY CORP         | 0.65              | 66             | 7,445           |
| UDR INC                      | 1.9               | 74             | 8,379           |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 1.45              | 169            | 19,007          |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 0.8               | 68             | 7,624           |
| アメリカ・ドル<br>通 貨 計             | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 79.301<br>39銘柄 | 4,509<br><1.9%> |

| 銘柄                           | 2017年11月30日現在     |                 |                 |
|------------------------------|-------------------|-----------------|-----------------|
|                              | □ 数               | 評価額             |                 |
|                              |                   | 外貨建金額           | 邦貨換算金額          |
| (カナダ)                        | 千口                | 千カナダ・ドル         | 千円              |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 2                 | 41              | 3,654           |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 1.4               | 34              | 3,031           |
| カナダ・ドル<br>通 貨 計              | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 3.4<br>2銘柄      | 76<br><0.0%>    |
| (オーストラリア)                    | 千口                | 千オーストラリア・ドル     | 千円              |
| LENDLEASE GROUP              | 4.303             | 69              | 5,879           |
| TRANSURBAN GROUP             | 11.52             | 144             | 12,299          |
| SYDNEY AIRPORT               | 9.129             | 68              | 5,810           |
| APA GROUP                    | 7.5               | 69              | 5,906           |
| SCENTRE GROUP                | 30.929            | 130             | 11,103          |
| DEXUS                        | 6.5               | 66              | 5,632           |
| GPT GROUP                    | 14.648            | 78              | 6,650           |
| MIRVAC GROUP                 | 31.638            | 77              | 6,551           |
| STOCKLAND                    | 14.3              | 66              | 5,679           |
| WESTFIELD CORP               | 13.956            | 116             | 9,901           |
| GOODMAN GROUP                | 8.8               | 76              | 6,505           |
| VICINITY CENTRES             | 19.523            | 54              | 4,606           |
| オーストラリア・ドル<br>通 貨 計          | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 172.746<br>12銘柄 | 1,019<br><0.3%> |
| (香港)                         | 千口                | 千香港ドル           | 千円              |
| LINK REIT                    | 13.5              | 949             | 13,628          |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 34                | 336             | 4,825           |
| 香港・ドル<br>通 貨 計               | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 47.5<br>2銘柄     | 1,285<br><0.1%> |
| (シンガポール)                     | 千口                | 千シンガポール・ドル      | 千円              |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 12                | 31              | 2,625           |
| CAPITALAND MALL TRUST        | 9                 | 18              | 1,542           |
| シンガポール・ドル<br>通 貨 計           | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 21<br>2銘柄       | 50<br><0.0%>    |
| (イギリス)                       | 千口                | 千イギリス・ポンド       | 千円              |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 4.808             | 44              | 6,721           |
| SEGRO PLC                    | 5.92              | 32              | 4,890           |
| HAMMERSON PLC                | 4.9               | 25              | 3,804           |
| BRITISH LAND CO PLC          | 6.3               | 39              | 5,909           |
| INTU PROPERTIES PLC          | 8.425             | 16              | 2,465           |
| イギリス・ポンド<br>通 貨 計            | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 30.353<br>5銘柄   | 158<br><0.1%>   |
| (ユーロ (フランス))                 | 千口                | 千ユーロ            | 千円              |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 0.609             | 132             | 17,583          |
| ICADE                        | 0.406             | 32              | 4,250           |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘 柄                  |         | 2017年11月30日現在 |       |         |
|----------------------|---------|---------------|-------|---------|
|                      |         | □ 数           | 評 価 額 |         |
|                      |         |               | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |
|                      |         | 千口            | 千ユーロ  | 千円      |
| GECINA SA            |         | 0.334         | 46    | 6,174   |
| KLEPIERRE            |         | 1.4           | 48    | 6,435   |
| FONCIERE DES REGIONS |         | 0.353         | 31    | 4,186   |
| ユーロ通貨計               | □ 数、金 額 | 3.102         | 290   | 38,630  |
|                      | 銘柄数<比率> | 5銘柄           |       | <0.1%>  |
| 合 計                  | □ 数、金 額 | 357.402       | —     | 683,496 |
|                      | 銘柄数<比率> | 67銘柄          |       | <2.5%>  |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信先買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

| 銘 柄 別 |                               | 2017年11月30日現在 |          |
|-------|-------------------------------|---------------|----------|
|       |                               | 買 建 額         | 売 建 額    |
| 外 国   | S & P500 E-MINI FUTURE (アメリカ) | 百万円<br>750    | 百万円<br>— |
|       | S & P/TSE 60 INDEX (カナダ)      | 16            | —        |
|       | SPI 200 INDEX (オーストラリア)       | 12            | —        |
|       | FT 100 (イギリス)                 | 44            | —        |
|       | SMI (スイス)                     | 21            | —        |
|       | EURO STOXX 50 (ドイツ)           | 119           | —        |
|       |                               |               |          |

(注1) 外貨建の資産は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信先買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書 第9期（決算日 2017年1月10日）

（計算期間 2016年1月13日～2017年1月10日）

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの第9期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

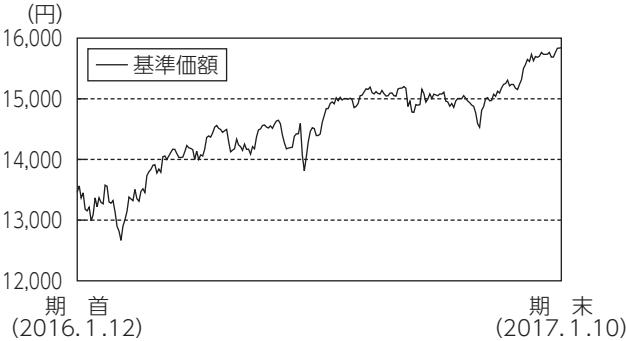
|             |                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針     | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                        |
| 主 要 投 資 対 象 | 海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）                                                                                                                                                                                                            |
| 運 用 方 法     | ①主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。<br>③運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 |
| 株 式 組 入 制 限 | 無制限                                                                                                                                                                                                                                                          |

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日          | 基 準 価 額 |       | MSCIコクサイ<br>指数(円ヘッジ・<br>ベース、指数化) |       | 株 式 組<br>比 | 株 式 先<br>比率 | 投 資 信 託<br>証 書 組<br>入比率 |
|----------------|---------|-------|----------------------------------|-------|------------|-------------|-------------------------|
|                | 円       | 騰落率   | 円                                | 騰落率   |            |             |                         |
| (期首)2016年1月12日 | 13,460  | -     | 11,197                           | -     | 87.7%      | 7.3%        | 2.4%                    |
| 1月末            | 13,269  | △ 1.4 | 11,041                           | △ 1.4 | 91.8%      | 7.6%        | 2.6%                    |
| 2月末            | 13,517  | 0.4   | 11,221                           | 0.2   | 86.2%      | 5.6%        | 2.4%                    |
| 3月末            | 14,229  | 5.7   | 11,780                           | 5.2   | 92.0%      | 6.5%        | 2.6%                    |
| 4月末            | 14,495  | 7.7   | 11,985                           | 7.0   | 91.1%      | 4.4%        | 2.5%                    |
| 5月末            | 14,568  | 8.2   | 12,002                           | 7.2   | 94.0%      | 6.7%        | 2.6%                    |
| 6月末            | 14,290  | 6.2   | 11,747                           | 4.9   | 85.9%      | 4.7%        | 2.6%                    |
| 7月末            | 14,992  | 11.4  | 12,320                           | 10.0  | 94.0%      | 4.4%        | 2.8%                    |
| 8月末            | 15,097  | 12.2  | 12,376                           | 10.5  | 93.3%      | 4.8%        | 2.8%                    |
| 9月末            | 15,006  | 11.5  | 12,287                           | 9.7   | 91.9%      | 3.6%        | 2.7%                    |
| 10月末           | 14,896  | 10.7  | 12,190                           | 8.9   | 92.7%      | 7.5%        | 2.5%                    |
| 11月末           | 15,238  | 13.2  | 12,449                           | 11.2  | 94.0%      | 10.3%       | 2.3%                    |
| 12月末           | 15,688  | 16.6  | 12,791                           | 14.2  | 92.0%      | 7.1%        | 2.4%                    |
| (期末)2017年1月10日 | 15,841  | 17.7  | 12,919                           | 15.4  | 91.1%      | 5.6%        | 2.5%                    |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース、指数化) は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.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。  
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。  
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】  
期首：13,460円 期末：15,841円 騰落率：17.7%  
【基準価額の主な変動要因】

MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行なった結果、原油価格が上昇したことや、米国の新政権の政策への期待から外国株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○外国株式市況  
米国・欧州を中心とする外国株式市況は、期首より、中国株や中国・人民元の下落、原油価格の下落、欧州の一部大手銀行に対する信用不安などが嫌気され、軟調な推移で始まりました。2016年3月以降は、原油価格が反発したことやECB (欧州中央銀行) によ

る追加金融緩和の発表、FOMC (米国連邦公開市場委員会) での利上げ見送りなどが好感され堅調に推移しました。6月下旬に英国の国民投票でEU (欧州連合) 離脱派が多数となると欧州情勢への懸念が高まり、市況は一時的に急落しましたが、その後は英国および各国の中央銀行が政策協調を表明したことが好感され、落ち着いた動きを取り戻し反発しました。7月以降は、米国企業の良好な決算内容などを受けて上昇基調となりましたが、米国の利上げ観測が台頭すると一進一退の展開となりました。11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことによる新政権の政策への期待から、市況は米国市場を中心に上昇基調となり期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク (MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) ) の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま

◆ポートフォリオについて

外国株式 (投資信託証券、株式先物を含む。以下同じ。) と為替予約の評価損益の合計の純資産総額に対する比率については、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。  
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は15.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は17.7%となりました。  
ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。その他、ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま

■1万口当りの費用の明細

| 項 目                                 | 当 期                     |
|-------------------------------------|-------------------------|
| 売買委託手数料<br>(株式)<br>(先物)<br>(投資信託証券) | 5円<br>(5)<br>(1)<br>(0) |
| 有価証券取引税<br>(株式)<br>(投資信託証券)         | 6<br>(6)<br>(0)         |
| その他費用<br>(保管費用)<br>(その他)            | 21<br>(19)<br>(2)       |
| 合 計                                 | 32                      |

(注1) 期中の費用 (消費税のかかるものは消費税を含む) は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。  
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

|   |                  | 買 付                         |                                | 売 付          |                       |
|---|------------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------|-----------------------|
|   |                  | 株 数                         | 金 額                            | 株 数          | 金 額                   |
| 外 | アメリカ             | 百株<br>5,623.95<br>(△ 44.68) | 千アメリカ・ドル<br>34,844<br>(△ 537)  | 百株<br>532.07 | 千アメリカ・ドル<br>2,590     |
|   | カナダ              | 百株<br>912.5<br>( 3.95)      | 千カナダ・ドル<br>3,559<br>( ー)       | 百株<br>182.57 | 千カナダ・ドル<br>753        |
|   | オーストラリア          | 百株<br>1,703.5<br>(△ 10.83)  | 千オーストラリア・ドル<br>2,365<br>(△ 18) | 百株<br>299.31 | 千オーストラリア・ドル<br>394    |
|   | 香港               | 百株<br>1,911<br>( 19.21)     | 千香港ドル<br>6,638<br>( ー)         | 百株<br>440    | 千香港ドル<br>1,556        |
|   | シンガポール           | 百株<br>1,187<br>( ー)         | 千シンガポール・ドル<br>445<br>(△ 0)     | 百株<br>193.18 | 千シンガポール・ドル<br>70      |
|   | ニュージーランド         | 百株<br>181<br>( ー)           | 千ニュージーランド・ドル<br>59<br>( ー)     | 百株<br>56     | 千ニュージーランド・ドル<br>21    |
|   | イギリス             | 百株<br>5,342.5<br>(△ 68.45)  | 千イギリス・ポンド<br>2,954<br>(△ 85)   | 百株<br>23.23  | 千イギリス・ポンド<br>19       |
|   | イスラエル            | 百株<br>42<br>( ー)            | 千イスラエル・シェケル<br>275<br>( ー)     | 百株<br>20     | 千イスラエル・シェケル<br>320    |
|   | スイス              | 百株<br>361.8<br>( ー)         | 千スイス・フラン<br>2,302<br>(△ 18)    | 百株<br>77.25  | 千スイス・フラン<br>427       |
|   | デンマーク            | 百株<br>91.16<br>( ー)         | 千デンマーク・クローネ<br>3,053<br>( ー)   | 百株<br>14     | 千デンマーク・クローネ<br>438    |
|   | ノルウェー            | 百株<br>107.5<br>( ー)         | 千ノルウェー・クローネ<br>1,518<br>(△ 1)  | 百株<br>7      | 千ノルウェー・クローネ<br>220    |
|   | スウェーデン           | 百株<br>621<br>( ー)           | 千スウェーデン・クローネ<br>7,565<br>(△ 9) | 百株<br>193    | 千スウェーデン・クローネ<br>1,874 |
|   | ユーロ<br>(アイルランド)  | 百株<br>1,317<br>( ー)         | 千ユーロ<br>107<br>( ー)            | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー             |
|   | ユーロ<br>(オランダ)    | 百株<br>339<br>( 6.51)        | 千ユーロ<br>686<br>(△ 2)           | 百株<br>16.5   | 千ユーロ<br>46            |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)    | 百株<br>35.5<br>(△ 1.5)       | 千ユーロ<br>268<br>( ー)            | 百株<br>2.8    | 千ユーロ<br>27            |
|   | ユーロ<br>(ルクセンブルグ) | 百株<br>73.6<br>( ー)          | 千ユーロ<br>96<br>(△ 0)            | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー             |
|   | ユーロ<br>(フランス)    | 百株<br>420.9<br>( 2.64)      | 千ユーロ<br>1,753<br>( 3)          | 百株<br>60     | 千ユーロ<br>28            |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)     | 百株<br>401.6<br>( 2.95)      | 千ユーロ<br>1,763<br>(△ 2)         | 百株<br>8.95   | 千ユーロ<br>31            |
|   | ユーロ<br>(ポルトガル)   | 百株<br>18<br>( ー)            | 千ユーロ<br>22<br>( ー)             | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー             |

|   |                 | 買 付                        |                        | 売 付          |             |
|---|-----------------|----------------------------|------------------------|--------------|-------------|
|   |                 | 株 数                        | 金 額                    | 株 数          | 金 額         |
| 外 | ユーロ<br>(スペイン)   | 百株<br>857<br>( 138.05)     | 千ユーロ<br>604<br>( 4)    | 百株<br>5      | 千ユーロ<br>15  |
|   | ユーロ<br>(イタリア)   | 百株<br>728.5<br>( 18.47)    | 千ユーロ<br>290<br>(△ 0)   | 百株<br>93.66  | 千ユーロ<br>16  |
|   | ユーロ<br>(フィンランド) | 百株<br>194.5<br>( ー)        | 千ユーロ<br>198<br>( ー)    | 百株<br>35     | 千ユーロ<br>17  |
|   | ユーロ<br>(オーストリア) | 百株<br>12.5<br>( ー)         | 千ユーロ<br>40<br>(△ 0)    | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー   |
|   | ユーロ<br>(その他)    | 百株<br>ー<br>( 5)            | 千ユーロ<br>ー<br>( 15)     | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー   |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 百株<br>4,398.1<br>( 172.12) | 千ユーロ<br>5,834<br>( 15) | 百株<br>221.91 | 千ユーロ<br>183 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

|   |               | 買 付                    |                            | 売 付                |                           |
|---|---------------|------------------------|----------------------------|--------------------|---------------------------|
|   |               | 口 数                    | 金 額                        | 口 数                | 金 額                       |
| 外 | アメリカ          | 千口<br>24.02<br>( 0.83) | 千アメリカ・ドル<br>1,215<br>( 8)  | 千口<br>0.49<br>( ー) | 千アメリカ・ドル<br>35<br>( ー)    |
|   | オーストラリア       | 千口<br>40.3<br>( ー)     | 千オーストラリア・ドル<br>194<br>( ー) | 千口<br>4.9<br>( ー)  | 千オーストラリア・ドル<br>25<br>( ー) |
|   | 香港            | 千口<br>6.5<br>( ー)      | 千香港ドル<br>349<br>( ー)       | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千香港ドル<br>ー<br>( ー)        |
|   | シンガポール        | 千口<br>12<br>( ー)       | 千シンガポール・ドル<br>29<br>(△ 0)  | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千シンガポール・ドル<br>ー<br>( ー)   |
|   | イギリス          | 千口<br>2.15<br>( ー)     | 千イギリス・ポンド<br>21<br>( ー)    | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千イギリス・ポンド<br>ー<br>( ー)    |
|   | ユーロ<br>(フランス) | 千口<br>0.76<br>( ー)     | 千ユーロ<br>82<br>( ー)         | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千ユーロ<br>ー<br>( ー)         |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

| 種 類 別    | 買 建          |              | 売 建      |          |
|----------|--------------|--------------|----------|----------|
|          | 新規買付額        | 決 済 額        | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外国株式先物取引 | 百万円<br>4,458 | 百万円<br>4,266 | 百万円<br>－ | 百万円<br>－ |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
株 式

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

| 当                          |   |       |         | 期      |                                     |   |      |        |        |
|----------------------------|---|-------|---------|--------|-------------------------------------|---|------|--------|--------|
| 買                          |   | 付     |         | 売      |                                     | 付 |      |        |        |
| 銘                          | 柄 | 株 数   | 金 額     | 平均単価   | 銘                                   | 柄 | 株 数  | 金 額    | 平均単価   |
|                            |   | 千株    | 千円      | 円      |                                     |   | 千株   | 千円     | 円      |
| APPLE INC (アメリカ)           |   | 9.6   | 118,004 | 12,292 | NESTLE SA-REG (スイス)                 |   | 1.7  | 13,489 | 7,934  |
| MICROSOFT CORP (アメリカ)      |   | 13    | 84,012  | 6,462  | HOME DEPOT INC (アメリカ)               |   | 0.85 | 12,087 | 14,220 |
| EXXON MOBIL CORP (アメリカ)    |   | 7.85  | 75,566  | 9,626  | BANK OF NOVA SCOTIA (カナダ)           |   | 2    | 11,173 | 5,586  |
| AMAZON.COM INC (アメリカ)      |   | 0.69  | 58,912  | 85,380 | CANADIAN NATL RAILWAY CO (カナダ)      |   | 1.5  | 10,273 | 6,849  |
| GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ) |   | 17.65 | 58,510  | 3,315  | GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)          |   | 3    | 10,012 | 3,337  |
| JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)   |   | 4.6   | 58,233  | 12,659 | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル) |   | 2    | 9,409  | 4,704  |
| NESTLE SA-REG (スイス)        |   | 7.2   | 57,241  | 7,950  | ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN (スイス) |   | 0.36 | 9,356  | 25,990 |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)      |   | 4.25  | 57,091  | 13,433 | TORONTO-DOMINION BANK (カナダ)         |   | 1.8  | 8,748  | 4,860  |
| JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ) |   | 6.1   | 48,423  | 7,938  | APPLE INC (アメリカ)                    |   | 0.75 | 7,988  | 10,651 |
| AT&T INC (アメリカ)            |   | 11.2  | 48,104  | 4,295  | COMCAST CORP-CLASS A (アメリカ)         |   | 1.2  | 7,929  | 6,607  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

| 銘 柄                                | 期 首 |      | 期 末      |        | 業 種 等      |
|------------------------------------|-----|------|----------|--------|------------|
|                                    | 株 数 | 株 数  | 評 価 額    |        |            |
|                                    |     |      | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
| (アメリカ)                             | 百株  | 百株   | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | —   | 3.5  | 23       | 2,684  | 情報技術       |
| PALO ALTO NETWORKS INC             | 1   | 2.5  | 33       | 3,876  | 情報技術       |
| JARDEN CORP                        | 3   | —    | —        | —      | その他        |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC           | 1   | 1    | 11       | 1,351  | ヘルスケア      |
| SYNCHRONY FINANCIAL                | 10  | 27.5 | 101      | 11,767 | 金融         |
| ABBOTT LABORATORIES                | 23  | 55.7 | 226      | 26,313 | ヘルスケア      |
| ARCONIC INC                        | 18  | 15   | 30       | 3,546  | 資本財・サービス   |
| VERISK ANALYTICS INC               | 2   | 5    | 40       | 4,738  | 資本財・サービス   |
| LAS VEGAS SANDS CORP               | 6   | 14   | 77       | 9,044  | 一般消費財・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A                 | 5   | 8    | 53       | 6,250  | 情報技術       |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV        | 4   | 10.5 | 81       | 9,501  | 情報技術       |
| QORVO INC                          | 2   | 2    | 10       | 1,260  | 情報技術       |
| AFLAC INC                          | 6   | 13.5 | 93       | 10,883 | 金融         |
| DARDEN RESTAURANTS INC             | 2   | 5    | 35       | 4,149  | 一般消費財・サービス |
| ADOBE SYSTEMS INC                  | 7   | 16   | 173      | 20,143 | 情報技術       |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 2   | 11   | 37       | 4,307  | 素材         |

| 銘 柄                          | 期 首  |       | 当 期 末    |        | 業 種 等      |
|------------------------------|------|-------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数  | 株 数   | 評 価 額    |        |            |
|                              |      |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株   | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 2    | 2     | 13       | 1,581  | 一般消費財・サービス |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL     | 5    | 5     | 9        | 1,117  | 金融         |
| GARMIN LTD                   | 2    | 2     | 9        | 1,115  | 一般消費財・サービス |
| AETNA INC                    | 5.94 | 10.44 | 128      | 14,912 | ヘルスケア      |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 3    | 6.5   | 95       | 11,027 | 素材         |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 11   | 22.5  | 264      | 30,669 | 資本財・サービス   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | —    | 7     | 37       | 4,334  | 情報技術       |
| WR BERKLEY CORP              | 2    | 2     | 13       | 1,529  | 金融         |
| AUTOZONE INC                 | 0.6  | 1     | 79       | 9,164  | 一般消費財・サービス |
| DOLLAR TREE INC              | 4.49 | 8.49  | 65       | 7,594  | 一般消費財・サービス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | —    | 32    | 112      | 13,009 | ヘルスケア      |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | —    | 5     | 38       | 4,477  | 公益事業       |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 3    | 6     | 48       | 5,605  | 素材         |
| DR HORTON INC                | 6    | 14.5  | 40       | 4,701  | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | —    | 4.5   | 22       | 2,610  | エネルギー      |
| DENTSPLY SIRONA INC          | —    | 7     | 40       | 4,746  | ヘルスケア      |

| 銘柄                            | 期 首   | 当 期 末  |              | 業 種 等   |            |
|-------------------------------|-------|--------|--------------|---------|------------|
|                               | 株 数   | 株 数    | 評 価 額        |         |            |
|                               |       |        | 外貨建金額 邦貨換算金額 |         |            |
|                               | 百株    | 百株     | 千アメリカ・ドル     | 千円      |            |
| AUTODESK INC                  | 4     | 7      | 55           | 6,460   | 情報技術       |
| MOODY'S CORP                  | 3     | 5.5    | 53           | 6,177   | 金融         |
| DEVON ENERGY CORP             | 7     | 13     | 60           | 7,021   | エネルギー      |
| ALBEMARLE CORP                | —     | 3      | 27           | 3,147   | 素材         |
| ATMOS ENERGY CORP             | —     | 3      | 21           | 2,546   | 公益事業       |
| ALLIANT ENERGY CORP           | 3     | 6      | 22           | 2,593   | 公益事業       |
| CITIGROUP INC                 | 43.8  | 91.8   | 552          | 64,104  | 金融         |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING     | 6     | 14     | 143          | 16,635  | 情報技術       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER       | 5.5   | 16.5   | 102          | 11,922  | 公益事業       |
| ALLEGHANY CORP                | —     | 0.3    | 18           | 2,096   | 金融         |
| DUN & BRADSTREET CORP         | 1     | 1      | 12           | 1,427   | 資本財・サービス   |
| DOMINO'S PIZZA INC            | —     | 1.5    | 24           | 2,861   | 一般消費財・サービス |
| HESS CORP                     | 4     | 8.5    | 51           | 5,974   | エネルギー      |
| DAVITA INC                    | 2     | 6      | 38           | 4,409   | ヘルスケア      |
| DANAHER CORP                  | 8     | 19     | 153          | 17,755  | ヘルスケア      |
| FORTIVE CORP                  | —     | 10     | 53           | 6,230   | 資本財・サービス   |
| AVNET INC                     | —     | 4      | 18           | 2,172   | 情報技術       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 1.85  | 18.25  | 104          | 12,066  | 金融         |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A      | 2     | 2      | 6            | 706     | 一般消費財・サービス |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C      | —     | 2.01   | 5            | 629     | 一般消費財・サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     | 10    | 19.5   | 87           | 10,118  | 生活必需品      |
| BUNGE LTD                     | 3     | 3      | 21           | 2,440   | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD           | 5.5   | 13     | 87           | 10,146  | 情報技術       |
| APPLE INC                     | 83    | 171.5  | 2,040        | 236,637 | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 6     | 14     | 100          | 11,627  | 金融         |
| BOEING CO/THE                 | 9.5   | 18.5   | 292          | 33,963  | 資本財・サービス   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 3     | 6      | 44           | 5,183   | 金融         |
| SPECTRA ENERGY CORP           | 10    | 23.5   | 99           | 11,546  | エネルギー      |
| BECTON DICKINSON AND CO       | 2.73  | 6.73   | 113          | 13,178  | ヘルスケア      |
| CDK GLOBAL INC                | —     | 6      | 36           | 4,187   | 情報技術       |
| NISOURCE INC                  | —     | 9      | 19           | 2,302   | 公益事業       |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP       | 5     | —      | —            | —       | その他        |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 3     | 3      | 21           | 2,545   | 資本財・サービス   |
| CR BARD INC                   | 1     | 2      | 46           | 5,337   | ヘルスケア      |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP  | 16    | 32     | 152          | 17,677  | 金融         |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    | 58.94 | 127.44 | 671          | 77,850  | 電気通信サービス   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B   | 17    | 37     | 599          | 69,515  | 金融         |
| ANSYS INC                     | —     | 2      | 18           | 2,186   | 情報技術       |
| H&R BLOCK INC                 | 3     | 3      | 7            | 820     | 一般消費財・サービス |
| BB&T CORP                     | 12    | 24.5   | 114          | 13,276  | 金融         |
| BROADCOM CORP-CL A            | 8     | —      | —            | —       | その他        |
| BAKER HUGHES INC              | 6.81  | 13.81  | 87           | 10,127  | エネルギー      |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO       | 24    | 52.5   | 313          | 36,363  | ヘルスケア      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO     | 1     | 1      | 7            | 879     | 生活必需品      |
| JPMORGAN CHASE & CO           | 55    | 113    | 973          | 112,925 | 金融         |
| LEGG MASON INC                | 3     | —      | —            | —       | 金融         |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 4     | 7.5    | 54           | 6,334   | 金融         |
| CIGNA CORP                    | 3.5   | 8      | 113          | 13,205  | ヘルスケア      |
| LKQ CORP                      | 5     | 12     | 37           | 4,340   | 一般消費財・サービス |
| COMPUTER SCIENCES CORP        | —     | 5      | 29           | 3,467   | 情報技術       |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD      | —     | 2      | 27           | 3,146   | 金融         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP  | 19.21 | 19.21  | 7            | 819     | 電気通信サービス   |

| 銘柄                           | 期 首   | 期 末   |              | 業 種 等  |            |
|------------------------------|-------|-------|--------------|--------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数   | 評 価 額        |        |            |
|                              |       |       | 外貨建金額 邦貨換算金額 |        |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル 千円  |        |            |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 1     | 9     | 40           | 4,670  | 生活必需品      |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | —     | 8     | 20           | 2,385  | 情報技術       |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 3     | 5.5   | 63           | 7,347  | 金融         |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 4     | 7.5   | 55           | 6,412  | 一般消費財・サービス |
| SERVICENOW INC               | 3     | 6     | 49           | 5,705  | 情報技術       |
| CATERPILLAR INC              | 9     | 17.5  | 161          | 18,744 | 資本財・サービス   |
| CMS ENERGY CORP              | 5     | 11    | 45           | 5,303  | 公益事業       |
| MOSAIC CO/THE                | 7     | 7     | 21           | 2,492  | 素材         |
| DELTA AIR LINES INC          | 4     | 4     | 19           | 2,304  | 資本財・サービス   |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO    | 3     | 7     | 50           | 5,811  | 生活必需品      |
| CORNING INC                  | 21    | 31    | 75           | 8,796  | 情報技術       |
| CISCO SYSTEMS INC            | 73    | 157.5 | 475          | 55,119 | 情報技術       |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS    | 13    | 26    | 191          | 22,226 | 素材         |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 2     | —     | —            | —      | ヘルスケア      |
| MORGAN STANLEY               | 23    | 43.5  | 185          | 21,544 | 金融         |
| WABCO HOLDINGS INC           | —     | 1.2   | 12           | 1,462  | 資本財・サービス   |
| DOW CHEMICAL CO/THE          | 16    | 33.5  | 193          | 22,449 | 素材         |
| MSCI INC                     | —     | 1.5   | 12           | 1,438  | 金融         |
| MIDDLEBY CORP                | —     | 2     | 26           | 3,038  | 資本財・サービス   |
| COTY INC-CL A                | —     | 11.17 | 21           | 2,441  | 生活必需品      |
| BROADCOM LTD                 | 4     | 11.84 | 209          | 24,297 | 情報技術       |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | —     | 1     | 14           | 1,714  | ヘルスケア      |
| ENSCO PLC-CL A               | 4     | —     | —            | —      | エネルギー      |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | —     | 2     | 10           | 1,248  | 一般消費財・サービス |
| ACUITY BRANDS INC            | 1     | 1     | 20           | 2,348  | 資本財・サービス   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 1     | —     | —            | —      | ヘルスケア      |
| ARAMARK                      | —     | 10    | 34           | 4,023  | 一般消費財・サービス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | —     | 5     | 13           | 1,600  | 素材         |
| DTE ENERGY COMPANY           | 2     | 5     | 48           | 5,675  | 公益事業       |
| CENTENE CORP                 | 2     | 5     | 30           | 3,593  | ヘルスケア      |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 6     | 15.5  | 55           | 6,413  | 金融         |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 4     | —     | —            | —      | その他        |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | —     | 7.5   | 39           | 4,557  | 金融         |
| GARTNER INC                  | —     | 2.5   | 23           | 2,777  | 情報技術       |
| SPLUNK INC                   | 2     | 6.5   | 36           | 4,197  | 情報技術       |
| WHITEWAVE FOODS CO           | 3     | 7.5   | 41           | 4,811  | 生活必需品      |
| AGCO CORP                    | 1     | 1     | 6            | 701    | 資本財・サービス   |
| DOMINION RESOURCES INC/VA    | 9     | 18.5  | 140          | 16,243 | 公益事業       |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 2     | 10.5  | 46           | 5,406  | 生活必需品      |
| SMITH (A.O.) CORP            | —     | 3     | 14           | 1,648  | 資本財・サービス   |
| DEERE & CO                   | 5     | 8     | 84           | 9,758  | 資本財・サービス   |
| QUANTA SERVICES INC          | 2     | —     | —            | —      | 資本財・サービス   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | —     | 5.5   | 43           | 5,088  | 情報技術       |
| TIME WARNER INC              | 12.66 | 25.16 | 235          | 27,293 | 一般消費財・サービス |
| VMWARE INC-CLASS A           | 2     | 2     | 16           | 1,868  | 情報技術       |
| BAXALTA INC                  | 8     | —     | —            | —      | その他        |
| TEGNA INC                    | —     | 11.5  | 24           | 2,892  | 一般消費財・サービス |
| NASDAQ INC                   | 1     | 5     | 33           | 3,929  | 金融         |
| TARGA RESOURCES CORP         | —     | 6     | 35           | 4,077  | エネルギー      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | —     | 2.5   | 30           | 3,557  | 金融         |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 5     | 11    | 80           | 9,280  | 公益事業       |
| MEDNAX INC                   | —     | 3     | 20           | 2,388  | ヘルスケア      |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期首    | 当 期 末 |          |         | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|-------|----------|---------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数   | 評 価 額    |         |            |
|                              |       |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 1     | 5     | 38       | 4,451   | 一般消費財・サービス |
| TELEFLEX INC                 | —     | 2     | 32       | 3,825   | ヘルスケア      |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 2     | 2     | 19       | 2,246   | 資本財・サービス   |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | —     | 3     | 24       | 2,843   | 資本財・サービス   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 12.5  | 25.5  | 169      | 19,640  | 生活必需品      |
| AMETEK INC                   | 4.75  | 9.75  | 48       | 5,611   | 資本財・サービス   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 2     | 9     | 39       | 4,623   | 生活必需品      |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 6     | 11.5  | 99       | 11,587  | 素材         |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 6     | 13.5  | 217      | 25,199  | 生活必需品      |
| SCANIA CORP                  | —     | 3     | 21       | 2,467   | 公益事業       |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC    | 1     | —     | —        | —       | その他        |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 1     | 1     | 14       | 1,663   | 金融         |
| WR GRACE & CO                | —     | 1.5   | 10       | 1,206   | 素材         |
| VALSPAR CORP/THE             | —     | 2     | 20       | 2,407   | 素材         |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 0.3   | 0.8   | 31       | 3,664   | 一般消費財・サービス |
| LEUCADIA NATIONAL CORP       | 4     | 14    | 32       | 3,769   | 金融         |
| UGI CORP                     | —     | 5     | 22       | 2,634   | 公益事業       |
| CUMMINS INC                  | 3     | 5     | 68       | 7,967   | 資本財・サービス   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 8     | 19.5  | 73       | 8,524   | 情報技術       |
| SABRE CORP                   | —     | 5     | 12       | 1,443   | 情報技術       |
| CDW CORP/DE                  | —     | 3     | 15       | 1,780   | 情報技術       |
| SIGNATURE BANK               | —     | 1.5   | 22       | 2,609   | 金融         |
| COSTAR GROUP INC             | —     | 1.5   | 28       | 3,347   | 情報技術       |
| MERCADOLIBRE INC             | —     | 1.5   | 26       | 3,028   | 情報技術       |
| HANESBRANDS INC              | 6     | 17    | 37       | 4,380   | 一般消費財・サービス |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 7     | 5.83  | 33       | 3,850   | 一般消費財・サービス |
| DEXCOM INC                   | —     | 4     | 24       | 2,898   | ヘルスケア      |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | —     | 3     | 30       | 3,528   | エネルギー      |
| SEATTLE GENETICS INC         | —     | 4     | 23       | 2,727   | ヘルスケア      |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | —     | 3     | 28       | 3,297   | ヘルスケア      |
| TRANSIGM GROUP INC           | 1     | 2     | 51       | 5,921   | 資本財・サービス   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 2     | 5     | 51       | 5,971   | 電気通信サービス   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC         | 6     | 11.5  | 48       | 5,648   | 資本財・サービス   |
| KINDER MORGAN INC            | 26.96 | 58.96 | 127      | 14,795  | エネルギー      |
| HCA HOLDINGS INC             | 5     | 11    | 86       | 10,066  | ヘルスケア      |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 8     | 18    | 39       | 4,610   | エネルギー      |
| T-MOBILE US INC              | 5     | 10.5  | 59       | 6,900   | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA CO/THE             | 62    | 128.5 | 530      | 61,570  | 生活必需品      |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 5     | —     | —        | —       | 生活必需品      |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 3     | 7.5   | 39       | 4,612   | 資本財・サービス   |
| EATON VANCE CORP             | —     | 6     | 25       | 2,987   | 金融         |
| FMC TECHNOLOGIES INC         | 2     | 11    | 39       | 4,577   | エネルギー      |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 7     | 15    | 60       | 7,011   | 金融         |
| CSX CORP                     | 12    | 31    | 114      | 13,297  | 資本財・サービス   |
| FLUOR CORP                   | 3     | 3     | 15       | 1,823   | 資本財・サービス   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 1     | 3.5   | 45       | 5,305   | ヘルスケア      |
| EXPEDIA INC                  | 2     | 4     | 46       | 5,440   | 一般消費財・サービス |
| AUTOLIV INC                  | 1.5   | 3.5   | 39       | 4,541   | 一般消費財・サービス |
| AMAZON.COM INC               | 6     | 12.7  | 1,012    | 117,361 | 一般消費財・サービス |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | —     | 7     | 25       | 2,902   | エネルギー      |
| FLOWSERVE CORP               | 3     | 3     | 14       | 1,687   | 資本財・サービス   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 4     | 7.5   | 73       | 8,518   | ヘルスケア      |

| 銘柄                           | 期 首   |        | 当 期 末    |         | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|--------|----------|---------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数    | 評 価 額    |         |            |
|                              |       |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| EXXON MOBIL CORP             | 61.26 | 131.76 | 1,146    | 132,987 | エネルギー      |
| FLIR SYSTEMS INC             | 1     | 1      | 3        | 413     | 情報技術       |
| AES CORP                     | 17    | 17     | 19       | 2,272   | 公益事業       |
| L3 TECHNOLOGIES INC          | 1     | 2.5    | 38       | 4,431   | 資本財・サービス   |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 1     | 1      | 21       | 2,515   | 金融         |
| EOG RESOURCES INC            | 7     | 19     | 195      | 22,697  | エネルギー      |
| EQT CORP                     | 3     | 6      | 37       | 4,395   | エネルギー      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 3     | 7      | 49       | 5,682   | 情報技術       |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 4     | 7      | 59       | 6,938   | ヘルスケア      |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 4     | 9.5    | 45       | 5,303   | ヘルスケア      |
| FORD MOTOR CO                | 50    | 108.5  | 137      | 15,890  | 一般消費財・サービス |
| MACY'S INC                   | 6     | 12     | 36       | 4,238   | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   | 2     | 2      | 5        | 623     | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 5.16  | 5.16   | 17       | 2,021   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY MEDIA CORP - A       | 2     | —      | —        | —       | その他        |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   | 3     | 3      | 7        | 913     | 一般消費財・サービス |
| MOBILEYE NV                  | —     | 5      | 19       | 2,311   | 情報技術       |
| AERCAP HOLDINGS NV           | —     | 8.5    | 36       | 4,252   | 資本財・サービス   |
| FORTINET INC                 | —     | 3.5    | 10       | 1,270   | 情報技術       |
| MARKEL CORP                  | 0.25  | 0.5    | 45       | 5,223   | 金融         |
| NEXTERA ENERGY INC           | 6.5   | 14     | 165      | 19,213  | 公益事業       |
| FREEPORT-MCMORAN INC         | 13.5  | 38.5   | 56       | 6,553   | 素材         |
| US BANCORP                   | 26    | 54     | 275      | 31,979  | 金融         |
| UNITED RENTALS INC           | 2     | 2      | 21       | 2,462   | 資本財・サービス   |
| F5 NETWORKS INC              | 1     | 3      | 43       | 5,014   | 情報技術       |
| FASTENAL CO                  | 3     | 9.5    | 43       | 5,086   | 資本財・サービス   |
| FISERV INC                   | 4     | 6.5    | 70       | 8,147   | 情報技術       |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 135   | 281.5  | 885      | 102,694 | 資本財・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 2     | 7.5    | 33       | 3,860   | 一般消費財・サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    | 3     | 11.5   | 36       | 4,245   | 一般消費財・サービス |
| GENERAL MOTORS CO            | 22    | 44     | 158      | 18,373  | 一般消費財・サービス |
| TRIPADVISOR INC              | 2     | 2      | 10       | 1,180   | 一般消費財・サービス |
| LINKEDIN CORP - A            | 2     | —      | —        | —       | 情報技術       |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 4     | 8.5    | 149      | 17,354  | 資本財・サービス   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 6     | 11.5   | 279      | 32,390  | 金融         |
| GAMESTOP CORP-CLASS A        | 2     | —      | —        | —       | 一般消費財・サービス |
| ALPHABET INC-CL A            | 4.2   | 9.3    | 769      | 89,205  | 情報技術       |
| ALPHABET INC-CL C            | 4.61  | 9.71   | 783      | 90,826  | 情報技術       |
| GENERAL MILLS INC            | 10    | 19     | 115      | 13,342  | 生活必需品      |
| FIRSTENERGY CORP             | 5.67  | 13.17  | 40       | 4,735   | 公益事業       |
| GENUINE PARTS CO             | 3     | 5.5    | 52       | 6,125   | 一般消費財・サービス |
| IHS MARKIT LTD               | —     | 13.55  | 49       | 5,746   | 資本財・サービス   |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 13    | 23.5   | 62       | 7,292   | 金融         |
| HARRIS CORP                  | 2     | 5      | 51       | 5,922   | 情報技術       |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 3     | 3      | 14       | 1,637   | 資本財・サービス   |
| HALLIBURTON CO               | 14    | 25     | 140      | 16,254  | エネルギー      |
| HOME DEPOT INC               | 18.5  | 39.5   | 530      | 61,519  | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC                 | —     | 2.5    | 23       | 2,728   | 金融         |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 12    | 36.5   | 48       | 5,637   | 金融         |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | —     | 2      | 38       | 4,416   | 資本財・サービス   |
| HERSHEY CO/THE               | 2     | 4.5    | 46       | 5,421   | 生活必需品      |
| HARLEY-DAVIDSON INC          | 4     | 4      | 23       | 2,697   | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           | 期首株数  | 当期末株数 | 期末評価額    |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|-------|----------|---------|------------|
|                              |       |       | 外貨建金額    |         |            |
|                              |       |       | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| HUMANA INC                   | 2     | 4.5   | 91       | 10,592  | ヘルスケア      |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS    | 2     | —     | —        | —       | その他        |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | —     | 10    | 98       | 11,376  | 情報技術       |
| HELMERICH & PAYNE            | 1     | 6     | 47       | 5,517   | エネルギー      |
| HENRY SCHEIN INC             | 2     | 2.5   | 39       | 4,558   | ヘルスケア      |
| HP INC                       | 26    | 58    | 85       | 9,873   | 情報技術       |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS    | 26    | 50    | 112      | 13,080  | 情報技術       |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | —     | 4     | 13       | 1,613   | 一般消費財・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP           | 2     | 2     | 6        | 717     | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | —     | 2     | 7        | 817     | 一般消費財・サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 2     | 5     | 42       | 4,941   | 金融         |
| HARMAN INTERNATIONAL         | —     | 1.5   | 16       | 1,923   | 一般消費財・サービス |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 8     | 18.5  | 159      | 18,464  | 生活必需品      |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 13.5  | 29    | 486      | 56,378  | 情報技術       |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 7     | 13.5  | 72       | 8,393   | 素材         |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 4     | 4     | 21       | 2,500   | 資本財・サービス   |
| ZOETIS INC                   | 8     | 16.5  | 89       | 10,322  | ヘルスケア      |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 3.15  | 9.65  | 72       | 8,381   | 資本財・サービス   |
| CHENIERE ENERGY INC          | 5     | 5     | 21       | 2,541   | エネルギー      |
| LEGGETT & PLATT INC          | 2     | 2     | 9        | 1,111   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C  | 10.86 | 18.86 | 61       | 7,151   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C | —     | 1.35  | 2        | 345     | 一般消費財・サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC        | —     | 7     | 56       | 6,578   | 資本財・サービス   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 9     | 9     | 25       | 2,962   | 情報技術       |
| JM SMUCKER CO/THE            | 1     | 4     | 51       | 5,937   | 生活必需品      |
| JOHNSON & JOHNSON            | 41.5  | 86    | 1,000    | 115,960 | ヘルスケア      |
| ABBVIE INC                   | 24.66 | 51.66 | 331      | 38,464  | ヘルスケア      |
| HOLOGIC INC                  | 3     | 11    | 44       | 5,108   | ヘルスケア      |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 5     | 10.5  | 120      | 13,958  | 生活必需品      |
| KROGER CO                    | 12    | 30    | 98       | 11,452  | 生活必需品      |
| KLA-TENCOR CORP              | 1.5   | 5     | 39       | 4,614   | 情報技術       |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 4     | 8.2   | 211      | 24,514  | 資本財・サービス   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 1     | 3.3   | 48       | 5,658   | 情報技術       |
| L BRANDS INC                 | 3     | 8.5   | 52       | 6,042   | 一般消費財・サービス |
| LOWE'S COS INC               | 14    | 27.5  | 195      | 22,663  | 一般消費財・サービス |
| ELI LILLY & CO               | 14.5  | 31.5  | 240      | 27,859  | ヘルスケア      |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 5     | 10    | 58       | 6,799   | 電気通信サービス   |
| LAM RESEARCH CORP            | 3     | 6     | 65       | 7,574   | 情報技術       |
| RANGE RESOURCES CORP         | 3     | 3     | 9        | 1,139   | エネルギー      |
| JONES LANG LASALLE INC       | —     | 1     | 10       | 1,236   | 不動産        |
| LOEWS CORP                   | 5     | 12    | 55       | 6,441   | 金融         |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 4     | 9     | 59       | 6,942   | 金融         |
| MCDONALD'S CORP              | 13.5  | 26    | 313      | 36,309  | 一般消費財・サービス |
| 3M CO                        | 9.5   | 19    | 336      | 39,056  | 資本財・サービス   |
| FACEBOOK INC-A               | 31.5  | 72.5  | 905      | 105,004 | 情報技術       |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | —     | 8.17  | 46       | 5,351   | 情報技術       |
| MANPOWERGROUP INC            | 1     | 1     | 8        | 1,041   | 資本財・サービス   |
| S&P GLOBAL INC               | 5     | 9     | 101      | 11,822  | 金融         |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 1     | 2.3   | 50       | 5,850   | 素材         |
| CONCHO RESOURCES INC         | 2     | 4     | 53       | 6,246   | エネルギー      |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | —     | 5.33  | 35       | 4,156   | ヘルスケア      |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | —     | 18.5  | 28       | 3,314   | 情報技術       |

| 銘柄                           | 期 首   | 期 末    |          |        | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|--------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数    | 評 価 額    |        |            |
|                              |       |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株    | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | —     | 8      | 24       | 2,873  | 電気通信サービス   |
| PHILLIPS 66                  | 7.5   | 15.5   | 130      | 15,101 | エネルギー      |
| CONDUENT INC                 | —     | 7.51   | 10       | 1,212  | 情報技術       |
| HILTON GRAND VACATIONS-WI    | —     | 1.75   | 4        | 537    | 一般消費財・サービス |
| MURPHY OIL CORP              | 3     | 3      | 9        | 1,063  | エネルギー      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 9     | 18     | 52       | 6,086  | 一般消費財・サービス |
| MATTEL INC                   | 6     | 14     | 42       | 4,954  | 一般消費財・サービス |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 2     | 4.5    | 40       | 4,703  | 生活必需品      |
| MYLAN NV                     | 7     | 12.5   | 48       | 5,645  | ヘルスケア      |
| METLIFE INC                  | 14    | 28     | 150      | 17,435 | 金融         |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 5     | 22     | 31       | 3,665  | 情報技術       |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 1.85  | 4.35   | 36       | 4,187  | 情報技術       |
| MONSANTO CO                  | 7     | 15     | 163      | 18,950 | 素材         |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 0.5   | 1      | 42       | 4,944  | ヘルスケア      |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 2     | 4      | 55       | 6,415  | 資本財・サービス   |
| MERCK & CO. INC.             | 42.37 | 87.87  | 536      | 62,257 | ヘルスケア      |
| MASCO CORP                   | 8     | 8      | 25       | 2,985  | 資本財・サービス   |
| M & T BANK CORP              | 2.32  | 4.32   | 67       | 7,812  | 金融         |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 9     | 16.5   | 111      | 12,972 | 金融         |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A  | 2.85  | 10.95  | 90       | 10,443 | 一般消費財・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 2     | 5      | 37       | 4,334  | 情報技術       |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 4     | 4      | 16       | 1,949  | 一般消費財・サービス |
| VANTIV INC - CL A            | —     | 4      | 24       | 2,873  | 情報技術       |
| NETAPP INC                   | 3     | 10     | 35       | 4,085  | 情報技術       |
| NIKE INC -CL B               | 19    | 43.5   | 232      | 26,926 | 一般消費財・サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 5     | 10     | 109      | 12,660 | 資本財・サービス   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 5     | 5      | 32       | 3,735  | 情報技術       |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | —     | 3      | 22       | 2,562  | 金融         |
| ALLY FINANCIAL INC           | 6     | 19     | 37       | 4,351  | 金融         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 2.5   | 5.5    | 129      | 15,039 | 資本財・サービス   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 5     | 9      | 61       | 7,103  | 一般消費財・サービス |
| NEWMONT MINING CORP          | 9     | 15.5   | 54       | 6,355  | 素材         |
| MCKESSON CORP                | 3.5   | 7      | 102      | 11,919 | ヘルスケア      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 6     | 6      | 24       | 2,828  | 情報技術       |
| XYLEM INC                    | —     | 7.5    | 37       | 4,293  | 資本財・サービス   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 23    | 49.5   | 451      | 52,412 | 生活必需品      |
| NUCOR CORP                   | 4     | 9      | 53       | 6,224  | 素材         |
| WESTERN UNION CO             | 10    | 10     | 22       | 2,614  | 情報技術       |
| NEWELL BRANDS INC            | 4     | 11.08  | 52       | 6,031  | 一般消費財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 10.5  | 23     | 162      | 18,797 | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA CORP - C       | 4     | —      | —        | —      | その他        |
| LIBERTY BROADBAND-C          | —     | 2      | 15       | 1,741  | 一般消費財・サービス |
| PAYCHEX INC                  | 7     | 8.5    | 51       | 6,014  | 情報技術       |
| PATTERSON COS INC            | 3     | 3      | 12       | 1,479  | ヘルスケア      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 1.5   | 3.5    | 97       | 11,339 | 一般消費財・サービス |
| ALTRIA GROUP INC             | 30    | 63     | 428      | 49,640 | 生活必需品      |
| P G & E CORP                 | 6     | 16.5   | 99       | 11,537 | 公益事業       |
| PFIZER INC                   | 91.58 | 192.08 | 642      | 74,549 | ヘルスケア      |
| ALKERMES PLC                 | 2     | 6      | 35       | 4,168  | ヘルスケア      |
| XCEL ENERGY INC              | 7     | 19     | 76       | 8,879  | 公益事業       |
| STRYKER CORP                 | 5     | 11     | 130      | 15,181 | ヘルスケア      |
| PARKER HANFIN CORP           | 2     | 4      | 56       | 6,529  | 資本財・サービス   |

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期 首   |       | 当 期 末    |        | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|-------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数   | 評 価 額    |        |            |
|                              |       |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 2     | 5.5   | 100      | 11,645 | エネルギー      |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 1     | 1     | 8        | 970    | 一般消費財・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 40    | 80.7  | 681      | 78,981 | 生活必需品      |
| EXELON CORP                  | 12.04 | 28.04 | 98       | 11,468 | 公益事業       |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 3     | 8     | 115      | 13,430 | ヘルスケア      |
| CONOCOPHILLIPS               | 19    | 37.5  | 186      | 21,594 | エネルギー      |
| PEPSICO INC                  | 20.85 | 45.85 | 474      | 55,007 | 生活必需品      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 7     | 13    | 136      | 15,789 | 金融         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 4     | 5.5   | 39       | 4,550  | 公益事業       |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 9.5   | 20    | 230      | 26,670 | 情報技術       |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 2     | 2     | 13       | 1,507  | 金融         |
| PENTAIR PLC                  | 1.75  | 5.75  | 32       | 3,771  | 資本財・サービス   |
| QUALCOMM INC                 | 24    | 46.5  | 305      | 35,399 | 情報技術       |
| PARTNERRE LTD                | 1     | —     | —        | —      | その他        |
| INVESCO LTD                  | 8     | 16    | 49       | 5,723  | 金融         |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 1     | 3     | 50       | 5,897  | 一般消費財・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 4     | 8.5   | 49       | 5,735  | 金融         |
| ENERGEN CORP                 | 1     | —     | —        | —      | エネルギー      |
| RAYTHEON COMPANY             | 4.5   | 10    | 148      | 17,184 | 資本財・サービス   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 1     | 1     | 7        | 866    | 一般消費財・サービス |
| RED HAT INC                  | 4     | 7     | 50       | 5,855  | 情報技術       |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 1     | 2.6   | 92       | 10,704 | ヘルスケア      |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 6     | 7     | 39       | 4,579  | 資本財・サービス   |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 0.7   | 1.6   | 244      | 28,380 | 一般消費財・サービス |
| ROSS STORES INC              | 5     | 13.5  | 88       | 10,245 | 一般消費財・サービス |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | —     | 2.5   | 21       | 2,544  | 素材         |
| RESMED INC                   | —     | 6     | 37       | 4,401  | ヘルスケア      |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 2     | 6     | 55       | 6,430  | ヘルスケア      |
| ROBERT HALF INTL INC         | 3     | 3     | 14       | 1,681  | 資本財・サービス   |
| REYNOLDS AMERICAN INC        | 11.48 | 25.98 | 144      | 16,783 | 生活必需品      |
| RITE AID CORP                | 15    | 45    | 38       | 4,409  | 生活必需品      |
| RALPH LAUREN CORP            | 1     | 1     | 8        | 1,011  | 一般消費財・サービス |
| ROCKWELL COLLINS INC         | 1     | 3     | 27       | 3,192  | 資本財・サービス   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 17    | 35.5  | 51       | 5,915  | 金融         |
| CHEVRON CORP                 | 27    | 59.5  | 689      | 79,925 | エネルギー      |
| EDISON INTERNATIONAL         | 6     | 9     | 63       | 7,411  | 公益事業       |
| TESLA MOTORS INC             | 1     | 4.5   | 104      | 12,068 | 一般消費財・サービス |
| SYMANTEC CORP                | 10    | 20    | 49       | 5,795  | 情報技術       |
| ENDO INTERNATIONAL PLC       | 3     | 3     | 4        | 570    | ヘルスケア      |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 3.02  | 5.52  | 64       | 7,531  | 資本財・サービス   |
| SYNOPSIS INC                 | 4     | 4     | 24       | 2,786  | 情報技術       |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 1     | 6.53  | 193      | 22,433 | 一般消費財・サービス |
| CBRE GROUP INC - A           | 4     | 12    | 37       | 4,331  | 不動産        |
| TWITTER INC                  | 8     | 25    | 43       | 5,073  | 情報技術       |
| NAVIENT CORP                 | 12    | —     | —        | —      | 金融         |
| SANDISK CORP                 | 2     | —     | —        | —      | その他        |
| SOUTHERN CO/THE              | 12    | 29    | 140      | 16,319 | 公益事業       |
| SYSCO CORP                   | 10    | 15    | 83       | 9,684  | 生活必需品      |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 5     | 9     | 105      | 12,243 | 金融         |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 7     | 7     | 6        | 791    | エネルギー      |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | —     | 4     | 20       | 2,374  | 金融         |
| STERICYCLE INC               | 2     | 2     | 15       | 1,828  | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 期 首   |        | 当 期 末    |        | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|--------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数    | 評 価 額    |        |            |
|                              |       |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株    | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| SCHLUMBERGER LTD             | 18.5  | 44.93  | 385      | 44,686 | エネルギー      |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 4     | 4      | 16       | 1,892  | 資本財・サービス   |
| AT&T INC                     | 87.2  | 194.7  | 794      | 92,115 | 電気通信サービス   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | —     | 5      | 25       | 2,916  | 資本財・サービス   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 1     | 2.8    | 78       | 9,051  | 素材         |
| SEMPRA ENERGY                | 3.5   | 8.5    | 86       | 9,992  | 公益事業       |
| TIFFANY & CO                 | 1.5   | 4.5    | 34       | 4,009  | 一般消費財・サービス |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 5     | 11     | 41       | 4,853  | 情報技術       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 16    | 33     | 245      | 28,447 | 情報技術       |
| SALESFORCE.COM INC           | 10    | 21     | 155      | 18,010 | 情報技術       |
| SIGNET JEWELERS LTD          | 1     | 1      | 8        | 998    | 一般消費財・サービス |
| WESTROCK CO                  | 3.12  | 7.12   | 37       | 4,309  | 素材         |
| TIME WARNER CABLE            | 4.57  | —      | —        | —      | その他        |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 7     | 27.53  | 117      | 13,599 | 資本財・サービス   |
| TESORO CORP                  | 2     | 4.5    | 36       | 4,262  | エネルギー      |
| UNION PACIFIC CORP           | 12.5  | 26.5   | 271      | 31,473 | 資本財・サービス   |
| MARATHON OIL CORP            | 11    | 24     | 41       | 4,842  | エネルギー      |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 9     | 18.5   | 91       | 10,610 | エネルギー      |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 13    | 26     | 289      | 33,616 | 資本財・サービス   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 10    | 21.5   | 246      | 28,613 | 資本財・サービス   |
| UNUM GROUP                   | 6     | 6      | 26       | 3,088  | 金融         |
| SPRINT CORP                  | 4.14  | 41.14  | 35       | 4,150  | 電気通信サービス   |
| QUINTILES IMS HOLDINGS INC   | —     | 3.53   | 27       | 3,192  | ヘルスケア      |
| VOYA FINANCIAL INC           | 5     | 5      | 19       | 2,280  | 金融         |
| AMEREN CORPORATION           | 6     | 8      | 41       | 4,823  | 公益事業       |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 14.5  | 30     | 485      | 56,339 | ヘルスケア      |
| VERISIGN INC                 | 3     | 1.5    | 12       | 1,423  | 情報技術       |
| VALERO ENERGY CORP           | 7     | 15     | 99       | 11,544 | エネルギー      |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 1     | 2.3    | 59       | 6,955  | 一般消費財・サービス |
| FNF GROUP                    | 4     | 11     | 37       | 4,361  | 金融         |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 2     | 2      | 22       | 2,586  | ヘルスケア      |
| ANTHEM INC                   | 3.5   | 8      | 114      | 13,246 | ヘルスケア      |
| WALT DISNEY CO/THE           | 23.5  | 48.5   | 525      | 60,942 | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO             | 71.37 | 149.87 | 812      | 94,263 | 金融         |
| FOOT LOCKER INC              | 3     | 3      | 21       | 2,465  | 一般消費財・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 6     | 12.5   | 87       | 10,114 | 資本財・サービス   |
| WILLIAMS COS INC             | 12    | 20     | 63       | 7,405  | エネルギー      |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 2     | 5      | 37       | 4,369  | 一般消費財・サービス |
| WHITING PETROLEUM CORP       | 4     | —      | —        | —      | エネルギー      |
| WHIRLPOOL CORP               | 1     | 2      | 36       | 4,211  | 一般消費財・サービス |
| WAL-MART STORES INC          | 24    | 48.5   | 333      | 38,642 | 生活必需品      |
| ZIMMER BIOMETH HOLDINGS INC  | 3     | 7.5    | 80       | 9,305  | ヘルスケア      |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 17    | 17     | 9        | 1,159  | エネルギー      |
| WYNN RESORTS LTD             | 2     | 2      | 18       | 2,151  | 一般消費財・サービス |
| XEROX CORP                   | 10.09 | 37.59  | 26       | 3,038  | 情報技術       |
| WABTEC CORP                  | 2     | 2      | 16       | 1,949  | 資本財・サービス   |
| TJX COMPANIES INC            | 9     | 20.5   | 156      | 18,090 | 一般消費財・サービス |
| WATERS CORP                  | 2     | 2.5    | 34       | 4,034  | ヘルスケア      |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | —     | 3.5    | 24       | 2,892  | 資本財・サービス   |
| ALLERGAN PLC                 | 5.89  | 12.59  | 277      | 32,133 | ヘルスケア      |
| WHOLE FOODS MARKET INC       | 7     | 7      | 21       | 2,497  | 生活必需品      |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 13    | 28.5   | 235      | 27,281 | 生活必需品      |

| 銘柄                           | 期 首    | 当 期 末  |                   | 業 種 等  |              |
|------------------------------|--------|--------|-------------------|--------|--------------|
|                              | 株 数    | 株 数    | 評 価 額             |        |              |
|                              |        |        | 外貨建金額<br>千アメリカ・ドル |        | 邦貨換算金額<br>千円 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 2.13   | 4.13   | 52                | 6,034  | 金融           |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 4      | 9.95   | 71                | 8,291  | 情報技術         |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 5      | 8.5    | 49                | 5,714  | 公益事業         |
| WESTAR ENERGY INC            | —      | 4      | 21                | 2,520  | 公益事業         |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 9      | 15     | 65                | 7,569  | 公益事業         |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 28     | 59     | 482               | 55,930 | 情報技術         |
| PPL CORP                     | 11     | 18     | 61                | 7,142  | 公益事業         |
| PULTEGROUP INC               | —      | 7      | 12                | 1,504  | 一般消費財・サービス   |
| PPG INDUSTRIES INC           | 4      | 9      | 86                | 10,055 | 素材           |
| NORTHERN TRUST CORP          | 3      | 6.5    | 57                | 6,710  | 金融           |
| PRECISION CASTPARTS CORP     | 2      | —      | —                 | —      | その他          |
| NVIDIA CORP                  | 7      | 16     | 171               | 19,904 | 情報技術         |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 7.53   | 15.03  | 177               | 20,600 | 金融           |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A | 6      | 18     | 34                | 4,055  | 一般消費財・サービス   |
| TERADATA CORP                | 3      | —      | —                 | —      | 情報技術         |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 4      | 7.5    | 46                | 5,448  | 生活必需品        |
| NETFLIX INC                  | 6      | 13     | 170               | 19,740 | 一般消費財・サービス   |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 6      | 12     | 176               | 20,523 | ヘルスケア        |
| NRG ENERGY INC               | 8      | —      | —                 | —      | 公益事業         |
| TORCHMARK CORP               | 3.5    | 3.5    | 25                | 2,999  | 金融           |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 2      | 5      | 46                | 5,335  | 金融           |
| TEXTRON INC                  | 5      | 10     | 49                | 5,744  | 資本財・サービス     |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 18     | 37.5   | 110               | 12,815 | 一般消費財・サービス   |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 9      | 9      | 25                | 3,002  | 一般消費財・サービス   |
| NEWS CORP - CLASS A          | 8      | 8      | 9                 | 1,113  | 一般消費財・サービス   |
| OGE ENERGY CORP              | —      | 5      | 16                | 1,921  | 公益事業         |
| OMNICOM GROUP                | 4      | 7.5    | 64                | 7,426  | 一般消費財・サービス   |
| ORACLE CORP                  | 49     | 99     | 386               | 44,806 | 情報技術         |
| MASTERCARD INC - A           | 15     | 30     | 322               | 37,414 | 情報技術         |
| ONEOK INC                    | 5      | 5      | 28                | 3,332  | エネルギー        |
| CENTURYLINK INC              | 8.47   | 16.97  | 42                | 4,964  | 電気通信サービス     |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 2      | 3.5    | 65                | 7,561  | 資本財・サービス     |
| YUM! BRANDS INC              | 6      | 9.5    | 61                | 7,116  | 一般消費財・サービス   |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 1      | 2.5    | 59                | 6,887  | 情報技術         |
| MOLSON COORS BREWING CO-B    | 2      | 6.5    | 63                | 7,407  | 生活必需品        |
| NOBLE ENERGY INC             | 5      | 10.5   | 39                | 4,553  | エネルギー        |
| BANK OF AMERICA CORP         | 157.13 | 322.63 | 727               | 84,364 | 金融           |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 2      | 5      | 45                | 5,277  | ヘルスケア        |
| NORDSTROM INC                | 2      | 2      | 9                 | 1,044  | 一般消費財・サービス   |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 14     | 25     | 189               | 21,991 | 金融           |
| ANALOG DEVICES INC           | 4      | 8      | 57                | 6,673  | 情報技術         |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 3      | 10     | 46                | 5,397  | 金融           |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 19.2   | 32.2   | 213               | 24,785 | 金融           |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC  | —      | 1      | 11                | 1,285  | 素材           |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 7      | 18     | 125               | 14,606 | エネルギー        |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 2      | 7      | 52                | 6,140  | 情報技術         |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 2      | 5.5    | 46                | 5,392  | 一般消費財・サービス   |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | —      | 5      | 21                | 2,453  | エネルギー        |
| MALLINCKRODT PLC             | 2      | 2      | 10                | 1,241  | ヘルスケア        |
| AVERY DENNISON CORP          | —      | 3      | 21                | 2,524  | 素材           |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 9      | 19.5   | 110               | 12,793 | 情報技術         |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 8      | 21     | 117               | 13,683 | 資本財・サービス     |

| 銘柄                           | 期 首  | 期 末   |          |        | 業 種 等      |
|------------------------------|------|-------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数  | 株 数   | 評 価 額    |        |            |
|                              |      |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株   | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| AON PLC                      | 4    | 8.5   | 96       | 11,177 | 金融         |
| AMGEN INC                    | 11   | 24    | 381      | 44,205 | ヘルスケア      |
| CORE LABORATORIES N.V.       | —    | 1     | 12       | 1,439  | エネルギー      |
| COACH INC                    | 5    | 12    | 41       | 4,868  | 一般消費財・サービス |
| EATON CORP PLC               | 7.62 | 15.12 | 101      | 11,726 | 資本財・サービス   |
| CELGENE CORP                 | 12   | 24.5  | 294      | 34,151 | ヘルスケア      |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 3    | 6     | 90       | 10,455 | 生活必需品      |
| APPLIED MATERIALS INC        | 18   | 33.5  | 109      | 12,733 | 情報技術       |
| CIT GROUP INC                | 2    | 9     | 38       | 4,490  | 金融         |
| CIMAREX ENERGY CO            | 1    | 2.5   | 34       | 4,040  | エネルギー      |
| CME GROUP INC                | 5    | 10    | 116      | 13,489 | 金融         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 5.89 | 14.89 | 56       | 6,573  | エネルギー      |
| ECOLAB INC                   | 4    | 8.5   | 101      | 11,713 | 素材         |
| EQUIFAX INC                  | 2    | 4.5   | 53       | 6,253  | 資本財・サービス   |
| GAP INC/THE                  | 3    | 3     | 7        | 829    | 一般消費財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC          | 22   | 41.5  | 314      | 36,496 | ヘルスケア      |
| ST JUDE MEDICAL INC          | 4    | —     | —        | —      | ヘルスケア      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 2.76 | 4.76  | 43       | 4,997  | 生活必需品      |
| HORMEL FOODS CORP            | 3    | 6     | 21       | 2,475  | 生活必需品      |
| STATE STREET CORP            | 7    | 13    | 105      | 12,266 | 金融         |
| STAPLES INC                  | 8    | 8     | 7        | 847    | 一般消費財・サービス |
| SUNTRUST BANKS INC           | 8    | 13.5  | 74       | 8,647  | 金融         |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 20   | 35.5  | 145      | 16,927 | 金融         |
| IHS INC-CLASS A              | 1    | —     | —        | —      | その他        |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 8    | 13    | 60       | 6,960  | ヘルスケア      |
| B/E AEROSPACE INC            | —    | 2.5   | 15       | 1,769  | 資本財・サービス   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 4    | 8     | 47       | 5,542  | 生活必需品      |
| CROWN HOLDINGS INC           | 3    | 3     | 15       | 1,839  | 素材         |
| CHUBB CORP                   | 3.5  | —     | —        | —      | その他        |
| CARDINAL HEALTH INC          | 4    | 9.5   | 71       | 8,235  | ヘルスケア      |
| FEDEX CORP                   | 4    | 8.5   | 161      | 18,696 | 資本財・サービス   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 8    | 15    | 131      | 15,209 | 金融         |
| FMC CORP                     | 3    | 3     | 17       | 2,015  | 素材         |
| FLEX LTD                     | 10   | 10    | 14       | 1,661  | 情報技術       |
| CERNER CORP                  | 5    | 9.5   | 45       | 5,286  | ヘルスケア      |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 2    | 2     | 23       | 2,680  | 素材         |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 3    | 5.5   | 49       | 5,790  | 情報技術       |
| INTEL CORP                   | 68   | 148.5 | 543      | 63,042 | 情報技術       |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP   | 2    | —     | —        | —      | その他        |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 7    | 17    | 39       | 4,634  | 一般消費財・サービス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 6    | 10.5  | 50       | 5,852  | 金融         |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 4.5  | 10    | 122      | 14,179 | 資本財・サービス   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 61   | 30    | 13       | 1,600  | 一般消費財・サービス |
| ILLUMINA INC                 | 2    | 5.5   | 77       | 9,027  | ヘルスケア      |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 12   | —     | —        | —      | エネルギー      |
| SEALED AIR CORP              | 3    | 8.5   | 40       | 4,639  | 素材         |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 0.5  | 1.3   | 83       | 9,667  | ヘルスケア      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | —    | 6     | 52       | 6,067  | 情報技術       |
| SNAP-ON INC                  | 1.5  | 1.5   | 26       | 3,026  | 資本財・サービス   |
| CALPINE CORP                 | —    | 12    | 14       | 1,646  | 公益事業       |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 5    | —     | —        | —      | その他        |
| CARMAX INC                   | 3    | 8     | 52       | 6,047  | 一般消費財・サービス |

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期 首   |       | 当 期 末    |         | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|-------|----------|---------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数   | 評 価 額    |         |            |
|                              |       |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| COMERICA INC                 | 3     | 7     | 48       | 5,644   | 金融         |
| INGREDION INC                | —     | 3     | 37       | 4,348   | 生活必需品      |
| DUKE ENERGY CORP             | 10.38 | 22.38 | 171      | 19,889  | 公益事業       |
| TARGET CORP                  | 8     | 17.5  | 125      | 14,495  | 一般消費財・サービス |
| DOVER CORP                   | 2     | 5.5   | 42       | 4,893   | 資本財・サービス   |
| WW GRAINGER INC              | 1     | 2.5   | 57       | 6,677   | 資本財・サービス   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 2     | 2     | 11       | 1,315   | 資本財・サービス   |
| JOHNSON CONTROLS INC         | 10    | —     | —        | —       | その他        |
| CINTAS CORP                  | 1     | 3.5   | 40       | 4,686   | 資本財・サービス   |
| CA INC                       | 6     | 6     | 19       | 2,313   | 情報技術       |
| CONAGRA BRANDS INC           | 5     | 11    | 42       | 4,903   | 生活必需品      |
| CLOROX COMPANY               | 2     | 4.5   | 54       | 6,329   | 生活必需品      |
| ENTERGY CORP                 | 2     | 4.5   | 31       | 3,709   | 公益事業       |
| MICROSOFT CORP               | 110   | 232   | 1,453    | 168,518 | 情報技術       |
| INCYTE CORP                  | 3     | 6     | 71       | 8,246   | ヘルスケア      |
| CVS HEALTH CORP              | 16.5  | 33    | 269      | 31,263  | 生活必需品      |
| MEDTRONIC PLC                | 21.56 | 42.56 | 314      | 36,432  | ヘルスケア      |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 19    | 36    | 80       | 9,325   | 情報技術       |
| BLACKROCK INC                | 2     | 3.8   | 144      | 16,763  | 金融         |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 9     | 9     | 22       | 2,596   | 公益事業       |
| HASBRO INC                   | 3     | 3     | 24       | 2,873   | 一般消費財・サービス |
| KELLOGG CO                   | 4     | 7     | 50       | 5,854   | 生活必需品      |
| KEYCORP                      | 11    | 40    | 73       | 8,469   | 金融         |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 2     | 2     | 16       | 1,891   | 資本財・サービス   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 25    | 52    | 232      | 26,947  | 生活必需品      |
| KOHL'S CORP                  | 3     | 7.5   | 30       | 3,562   | 一般消費財・サービス |
| COOPER COS INC/THE           | —     | 1     | 17       | 2,065   | ヘルスケア      |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 8     | 23    | 36       | 4,205   | 金融         |
| APACHE CORP                  | 6     | 14    | 87       | 10,123  | エネルギー      |
| CHUBB LTD                    | 4     | 14.1  | 184      | 21,338  | 金融         |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 1     | 4.5   | 32       | 3,772   | 情報技術       |
| ALLSTATE CORP                | 5     | 12.5  | 91       | 10,594  | 金融         |
| EBAY INC                     | 16.5  | 34    | 104      | 12,123  | 情報技術       |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 16.5  | 34    | 140      | 16,322  | 情報技術       |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 2     | 6     | 45       | 5,330   | 素材         |
| XILINX INC                   | 3     | 8     | 47       | 5,478   | 情報技術       |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 10.35 | 21.35 | 152      | 17,716  | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A          | 3     | 6.5   | 40       | 4,646   | 一般消費財・サービス |
| YAHOO! INC                   | 11    | 28.5  | 117      | 13,662  | 情報技術       |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 3     | 5.5   | 43       | 4,989   | 生活必需品      |
| TOLL BROTHERS INC            | 4     | 4     | 12       | 1,443   | 一般消費財・サービス |
| TRIMBLE INC                  | —     | 5     | 15       | 1,753   | 情報技術       |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP       | 4     | 9     | 56       | 6,495   | 情報技術       |
| LENNAR CORP-A                | 3     | 8.5   | 37       | 4,292   | 一般消費財・サービス |
| LEAR CORP                    | 2     | 2     | 27       | 3,153   | 一般消費財・サービス |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 7     | 7     | 25       | 2,959   | 金融         |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC    | 6     | —     | —        | —       | 資本財・サービス   |
| PROGRESSIVE CORP             | 8     | 15.5  | 55       | 6,420   | 金融         |
| PRAXAIR INC                  | 4     | 8     | 93       | 10,812  | 素材         |
| PACCAR INC                   | 6     | 11    | 71       | 8,300   | 資本財・サービス   |
| PVH CORP                     | 1     | 3.5   | 32       | 3,744   | 一般消費財・サービス |
| EMC CORP/MA                  | 26    | —     | —        | —       | その他        |

| 銘柄                          | 期首               | 期末                |                   |                   | 業種等        |
|-----------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------|
|                             | 株数               | 株数                | 評価額               |                   |            |
|                             |                  |                   | 外貨建金額             | 邦貨換算金額            |            |
|                             | 百株               | 百株                | 千アメリカ・ドル          | 千円                |            |
| BIOGEN INC                  | 3.5              | 6.5               | 194               | 22,538            | ヘルスケア      |
| IDEXX LABORATORIES INC      | —                | 2                 | 23                | 2,760             | ヘルスケア      |
| STARBUCKS CORP              | 21               | 46.5              | 270               | 31,382            | 一般消費財・サービス |
| PERRIGO CO PLC              | 2                | 5                 | 42                | 4,953             | ヘルスケア      |
| EVERSOURCE ENERGY           | 5                | 10                | 54                | 6,327             | 公益事業       |
| INTUIT INC                  | 4                | 8                 | 93                | 10,808            | 情報技術       |
| BORGWARNER INC              | 3                | 9                 | 36                | 4,260             | 一般消費財・サービス |
| BEST BUY CO INC             | 5                | 11                | 47                | 5,528             | 一般消費財・サービス |
| BALL CORP                   | 2                | 5.46              | 41                | 4,810             | 素材         |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 23               | 45.5              | 100               | 11,707            | ヘルスケア      |
| BED BATH & BEYOND INC       | 3                | 3                 | 12                | 1,406             | 一般消費財・サービス |
| XL GROUP LTD                | 4                | 12                | 44                | 5,115             | 金融         |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 4                | 10.5              | 82                | 9,575             | 情報技術       |
| VULCAN MATERIALS CO         | 1.5              | 3.5               | 42                | 4,980             | 素材         |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC  | 4                | 6.5               | 53                | 6,245             | ヘルスケア      |
| VF CORP                     | 6                | 11                | 58                | 6,751             | 一般消費財・サービス |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 6                | 14                | 88                | 10,305            | 一般消費財・サービス |
| VIACOM INC-CLASS B          | 6                | 14                | 53                | 6,224             | 一般消費財・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC       | 1                | 2.5               | 50                | 5,906             | 一般消費財・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC   | 5                | 5                 | 8                 | 928               | 情報技術       |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC  | 1                | 3                 | 26                | 3,115             | ヘルスケア      |
| CARNIVAL CORP               | 5                | 10                | 53                | 6,225             | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A        | 38               | 75                | 531               | 61,600            | 一般消費財・サービス |
| JARDINE MATHESON HDGS LTD   | —                | 10                | 60                | 6,957             | 資本財・サービス   |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD  | —                | 20                | 13                | 1,590             | 不動産        |
| アメリカ・ドル<br>通貨計              | 株数・金額<br>総額数(比率) | 4,674.57<br>532銘柄 | 9,721.77<br>594銘柄 | -63.131<br><5.9%> | 7,320,709  |
| (カナダ)                       | 百株               | 百株                | 千カナダ・ドル           | 千円                |            |
| IMPERIAL OIL LTD            | 7                | 14                | 64                | 5,623             | エネルギー      |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC  | —                | 0.5               | 30                | 2,671             | 情報技術       |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD      | —                | 9.38              | 30                | 2,668             | エネルギー      |
| RESTAURANT BRANDS INTERN    | 3.21             | 8.21              | 53                | 4,708             | 一般消費財・サービス |
| SILVER WHEATON CORP         | 9                | 9                 | 24                | 2,113             | 素材         |
| INTACT FINANCIAL CORP       | 3                | 3                 | 28                | 2,506             | 金融         |
| BCE INC                     | 2                | 3                 | 17                | 1,524             | 電気通信サービス   |
| FRANCO-NEVADA CORP          | 3                | 7                 | 56                | 4,990             | 素材         |
| SUNCOR ENERGY INC           | 21.12            | 61.12             | 265               | 23,316            | エネルギー      |
| METRO INC                   | 6                | 6                 | 24                | 2,106             | 生活必需品      |
| NATIONAL BANK OF CANADA     | 4                | 10                | 55                | 4,824             | 金融         |
| BANK OF NOVA SCOTIA         | 18               | 43                | 328               | 28,798            | 金融         |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 7                | 14                | 155               | 13,672            | 金融         |
| TORONTO-DOMINION BANK       | 30               | 63                | 422               | 37,048            | 金融         |
| GREAT-WEST LIFE CO INC      | 6                | 7                 | 24                | 2,168             | 金融         |
| ROYAL BANK OF CANADA        | 23               | 51                | 471               | 41,390            | 金融         |
| TOURMALINE OIL CORP         | 3                | 13                | 42                | 3,691             | エネルギー      |
| VERMILION ENERGY INC        | 4                | 4                 | 22                | 1,971             | エネルギー      |
| TRANSNADANA CORP            | 12               | 27                | 164               | 14,438            | エネルギー      |
| PEMBINA PIPELINE CORP       | 9                | 18                | 75                | 6,589             | エネルギー      |
| BOMBARDIER INC-B            | 47               | 47                | 11                | 977               | 資本財・サービス   |
| BARRICK GOLD CORP           | 26               | 47                | 105               | 9,243             | 素材         |
| CAE INC                     | 7                | 7                 | 12                | 1,129             | 資本財・サービス   |
| THOMSON REUTERS CORP        | 3.2              | 14.2              | 83                | 7,344             | 金融         |

| 銘柄                           | 期 首   | 期 末   |         |        | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|-------|---------|--------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数   | 評 価 額   |        |            |
|                              |       |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千カナダ・ドル | 千円     |            |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 14    | 26    | 63      | 5,583  | 素材         |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | —     | 1     | 25      | 2,244  | 素材         |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | —     | 19    | 23      | 2,070  | 金融         |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | —     | 11    | 29      | 2,611  | エネルギー      |
| HYDRO ONE LTD                | —     | 15    | 35      | 3,102  | 公益事業       |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 4.89  | 9.89  | 69      | 6,081  | 生活必需品      |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | —     | 10    | 36      | 3,171  | 公益事業       |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 8     | 15    | 77      | 6,763  | 電気通信サービス   |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 2     | 6     | 34      | 3,068  | 素材         |
| KINROSS GOLD CORP            | 25.34 | 25.34 | 11      | 982    | 素材         |
| BANK OF MONTREAL             | 11    | 22    | 214     | 18,788 | 金融         |
| POWER CORP OF CANADA         | 5     | 16    | 48      | 4,238  | 金融         |
| METHANEX CORP                | —     | 6     | 36      | 3,189  | 素材         |
| CAMECO CORP                  | 4     | 4     | 5       | 498    | エネルギー      |
| TELUS CORP                   | 3     | 3     | 13      | 1,156  | 電気通信サービス   |
| POWER FINANCIAL CORP         | 2     | 10    | 33      | 2,960  | 金融         |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 6     | 17    | 46      | 4,097  | 素材         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 1     | 3     | 42      | 3,685  | 一般消費財・サービス |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | —     | 80    | 34      | 3,059  | 素材         |
| AGRIUM INC                   | 3     | 6     | 81      | 7,131  | 素材         |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 19    | 41    | 171     | 15,040 | エネルギー      |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 0.5   | 0.5   | 31      | 2,787  | 金融         |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 7     | 12    | 70      | 6,169  | 一般消費財・サービス |
| WESTON (GEORGE) LTD          | —     | 2     | 22      | 1,979  | 生活必需品      |
| BLACKBERRY LTD               | —     | 27    | 25      | 2,233  | 情報技術       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 12    | 19    | 97      | 8,576  | 金融         |
| ENBRIDGE INC                 | 14    | 30    | 172     | 15,131 | エネルギー      |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 16    | 31    | 135     | 11,845 | 金融         |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 32    | 63    | 152     | 13,401 | 金融         |
| GOLDCORP INC                 | 12    | 26    | 49      | 4,363  | 素材         |
| ENCANA CORP                  | 15    | 44    | 74      | 6,495  | エネルギー      |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 3     | 4     | 76      | 6,753  | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 4     | 4     | 21      | 1,896  | 金融         |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 4     | 4     | 13      | 1,172  | 一般消費財・サービス |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 12    | 25    | 227     | 19,954 | 資本財・サービス   |
| CGI GROUP INC - CLASS A      | 3     | 7     | 45      | 3,990  | 情報技術       |
| HUSKY ENERGY INC             | 6.12  | 6.12  | 9       | 866    | エネルギー      |
| ONEX CORPORATION             | 3     | 3     | 26      | 2,340  | 金融         |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 7     | 22    | 61      | 5,359  | 一般消費財・サービス |
| FINNING INTERNATIONAL INC    | 7     | 7     | 18      | 1,582  | 資本財・サービス   |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 3     | 3     | 17      | 1,515  | 資本財・サービス   |
| ELDORADO GOLD CORP           | 3     | 3     | 1       | 116    | 素材         |
| IGM FINANCIAL INC            | 3     | 3     | 12      | 1,056  | 金融         |
| OPEN TEXT CORP               | 4     | 3     | 24      | 2,166  | 情報技術       |
| CI FINANCIAL CORP            | 6     | 6     | 17      | 1,494  | 金融         |
| SAPUTO INC                   | 6     | 6     | 28      | 2,466  | 生活必需品      |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 9     | 33    | 47      | 4,174  | 素材         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B   | 8     | 13    | 79      | 6,957  | 生活必需品      |
| YAMANA GOLD INC              | 42    | 52    | 21      | 1,911  | 素材         |
| FORTIS INC                   | 5     | 13    | 53      | 4,675  | 公益事業       |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP   | 8     | 25    | 42      | 3,754  | エネルギー      |
| CENOVUS ENERGY INC           | 12    | 25    | 49      | 4,348  | エネルギー      |
| DOLLARAMA INC                | —     | 2     | 19      | 1,730  | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                            | 期 首            |                  | 当 期 末       |                    | 業 種 等      |
|-------------------------------|----------------|------------------|-------------|--------------------|------------|
|                               | 株 数            | 株 数              | 評 価 額       |                    |            |
|                               |                |                  | 外貨建金額       | 邦貨換算金額             |            |
|                               | 百株             | 百株               | 千カナダ・ドル     | 千円                 |            |
| ALTAGAS LTD                   | —              | 8                | 27          | 2,425              | エネルギー      |
| KEYERA CORP                   | —              | 7                | 28          | 2,497              | エネルギー      |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP  | —              | 7                | 21          | 1,850              | エネルギー      |
| INTER PIPELINE LTD            | 8              | 8                | 23          | 2,062              | エネルギー      |
| CANADIAN OIL SANDS LTD        | 16             | —                | —           | —                  | その他        |
| ARC RESOURCES LTD             | 10             | 10               | 22          | 1,936              | エネルギー      |
| カナダ・ドル 株数・金額<br>通 貨 計 総額数<比率> | 662.38<br>68銘柄 | 1,396.26<br>82銘柄 | 5,575<br>—  | 489,083<br>< 4.0%> |            |
| (オーストラリア)                     | 百株             | 百株               | 千オーストラリア・ドル | 千円                 |            |
| MEDIBANK PRIVATE LTD          | —              | 93               | 26          | 2,257              | 金融         |
| BHP BILLITON LIMITED          | 56             | 116              | 295         | 25,160             | 素材         |
| SOUTH32 LTD                   | 91             | 225              | 62          | 5,307              | 素材         |
| LENDELEASE GROUP              | 20             | 20               | 28          | 2,450              | 不動産        |
| ASCIANO LTD                   | 21.33          | —                | —           | —                  | その他        |
| ALUMINA LTD                   | 121            | 121              | 21          | 1,844              | 素材         |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD        | 10             | 20               | 63          | 5,429              | エネルギー      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD    | 48             | 48               | 28          | 2,387              | 素材         |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK     | 8              | 8                | 10          | 895                | 金融         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD   | 42             | 87               | 278         | 23,752             | 金融         |
| WESTPAC BANKING CORP          | 50.81          | 108.5            | 368         | 31,387             | 金融         |
| SANTOS LTD                    | 16             | 96               | 40          | 3,458              | エネルギー      |
| AUST AND NZ BANKING GROUP     | 47             | 97               | 308         | 26,243             | 金融         |
| RIO TINTO LTD                 | 7              | 12               | 71          | 6,065              | 素材         |
| ORIGIN ENERGY LTD             | 20             | 68               | 46          | 3,926              | エネルギー      |
| AMCOR LIMITED                 | 25             | 51               | 77          | 6,575              | 素材         |
| AURIZON HOLDINGS LTD          | 22             | 85               | 44          | 3,800              | 資本財・サービス   |
| OIL SEARCH LTD                | 32             | 32               | 23          | 2,030              | エネルギー      |
| SEEK LTD                      | —              | 26               | 39          | 3,376              | 資本財・サービス   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD     | —              | 26               | 27          | 2,373              | 生活必需品      |
| NEWCREST MINING LTD           | 9              | 22               | 45          | 3,851              | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD             | 73             | 73               | 26          | 2,281              | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL  | 30             | 58               | 494         | 42,112             | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD          | —              | 8                | 24          | 2,073              | エネルギー      |
| ORICA LTD                     | 2              | 20               | 36          | 3,079              | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD       | 30             | 60               | 76          | 6,540              | 金融         |
| WOOLWORTHS LTD                | 21             | 49               | 119         | 10,177             | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD          | —              | 26               | 26          | 2,282              | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD          | 24             | 24               | 11          | 1,005              | 一般消費財・サービス |
| TELSTRA CORP LTD              | 74             | 136              | 71          | 6,115              | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                       | 40.13          | 93.13            | 49          | 4,219              | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI   | 12             | 12               | 26          | 2,229              | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD           | 4.81           | 12.31            | 109         | 9,309              | 金融         |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD        | —              | 20               | 31          | 2,702              | 一般消費財・サービス |
| BANK OF QUEENSLAND LTD        | —              | 30               | 37          | 3,167              | 金融         |
| CSL LTD                       | 7              | 15.5             | 161         | 13,727             | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD                | 20.75          | 35.75            | 150         | 12,829             | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                  | —              | 2                | 25          | 2,196              | ヘルスケア      |
| SUNCORP GROUP LTD             | 19             | 39               | 53          | 4,589              | 金融         |
| BORAL LTD                     | 24             | 24               | 13          | 1,122              | 素材         |
| ASX LTD                       | 6              | 6                | 30          | 2,623              | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD             | 9              | 9                | 11          | 959                | 情報技術       |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP     | 57             | 57               | 35          | 2,999              | 金融         |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期 首              |                  | 当 期 末            |                  | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数              | 評 価 額            |                  |            |
|                              |                  |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額           |            |
|                              |                  | 百株               | 百株               | オーストラリア・ドル       | 千円         |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 5                | 8                | 17               | 1,506            | ヘルスケア      |
| TRANSURBAN GROUP             | 23.22            | 80.22            | 84               | 7,200            | 資本財・サービス   |
| ILUKA RESOURCES LTD          | 7                | —                | —                | —                | 素材         |
| CHALLENGER LTD               | —                | 25               | 28               | 2,463            | 金融         |
| SYDNEY AIRPORT               | 46               | 38               | 23               | 1,964            | 資本財・サービス   |
| TATTS GROUP LTD              | —                | 80               | 35               | 3,058            | 一般消費財・サービス |
| AGL ENERGY LTD               | 9                | 25               | 55               | 4,764            | 公益事業       |
| BRAMBLES LTD                 | 24               | 45               | 57               | 4,855            | 資本財・サービス   |
| APA GROUP                    | —                | 31               | 27               | 2,360            | 公益事業       |
| DUET GROUP                   | —                | 100              | 27               | 2,375            | 公益事業       |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | —                | 4                | 29               | 2,469            | ヘルスケア      |
| オーストラリア・ドル<br>通 貨 計          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,214.05<br>41銘柄 | 2,607.41<br>52銘柄 | 3,921<br>333,940 | < 2.7%>    |
| (香港)                         |                  | 百株               | 百株               | 千香港ドル            | 千円         |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 30               | 60               | 420              | 6,279            | 公益事業       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 60               | 60               | 212              | 3,179            | 一般消費財・サービス |
| MTR CORP                     | 20               | 75               | 287              | 4,299            | 資本財・サービス   |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 30               | 50               | 520              | 7,774            | 不動産        |
| SINO LAND CO                 | 28               | 120              | 144              | 2,167            | 不動産        |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 40.52            | 100.52           | 904              | 13,524           | 資本財・サービス   |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 40               | 40               | 224              | 3,354            | 不動産        |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 10               | 10               | 77               | 1,154            | 不動産        |
| CLP HOLDINGS LTD             | 25               | 70               | 516              | 7,717            | 公益事業       |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS       | 40               | 40               | 42               | 630              | 資本財・サービス   |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 33.55            | 36.9             | 155              | 2,319            | 不動産        |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 158.65           | 324.51           | 455              | 6,811            | 公益事業       |
| HANG SENG BANK LTD           | 10               | 34               | 505              | 7,563            | 金融         |
| WHEELLOCK & CO LTD           | 20               | 20               | 91               | 1,364            | 不動産        |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 90               | 90               | 76               | 1,143            | 不動産        |
| WH GROUP LTD                 | —                | 225              | 137              | 2,061            | 生活必需品      |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 17               | 38               | 705              | 10,543           | 金融         |
| LI & FUNG LTD                | 60               | 60               | 21               | 313              | 一般消費財・サービス |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 20               | 120              | 207              | 3,096            | 不動産        |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     | 10               | 10               | 27               | 404              | 一般消費財・サービス |
| BANK OF EAST ASIA LTD        | 20               | 20               | 62               | 935              | 金融         |
| SJM HOLDINGS LTD             | 100              | 100              | 60               | 905              | 一般消費財・サービス |
| SWIRE PROPERTIES LTD         | —                | 80               | 178              | 2,673            | 不動産        |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 40.52            | 105.52           | 526              | 7,863            | 不動産        |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE   | 20               | 20               | 123              | 1,840            | 公益事業       |
| AIA GROUP LTD                | 206              | 380              | 1,723            | 25,763           | 金融         |
| SANDS CHINA LTD              | 42               | 102              | 352              | 5,268            | 一般消費財・サービス |
| SHANGRI-LA ASIA LTD          | 40               | 40               | 32               | 490              | 一般消費財・サービス |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | —                | 55               | 152              | 2,281            | 一般消費財・サービス |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 70               | 155              | 444              | 6,638            | 金融         |
| WYNN MACAU LTD               | 60               | 60               | 78               | 1,169            | 一般消費財・サービス |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | —                | 130              | 120              | 1,805            | 電気通信サービス   |
| 香港ドル<br>通 貨 計                | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,341.24<br>28銘柄 | 2,831.45<br>32銘柄 | 9,588<br>143,343 | < 1.2%>    |
| (シンガポール)                     |                  | 百株               | 百株               | 千シンガポール・ドル       | 千円         |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 21               | 53               | 110              | 8,961            | 金融         |

| 銘 柄                          | 期 首              |                | 当 期 末         |               | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|----------------|---------------|---------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数            | 評 価 額         |               |            |
|                              |                  |                | 外貨建金額         | 邦貨換算金額        |            |
|                              |                  | 百株             | 百株            | 千円            |            |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 30               | 68             | 121           | 9,806         | 金融         |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 20               | 20             | 19            | 1,588         | 資本財・サービス   |
| KEPPEL CORP LTD              | 28               | 28             | 16            | 1,370         | 資本財・サービス   |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 10               | 10             | 8             | 688           | 不動産        |
| CAPITALAND LTD               | 70               | 70             | 21            | 1,747         | 不動産        |
| SEMBCORP MARINE LTD          | 20               | —              | —             | —             | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 30               | 120            | 43            | 3,509         | 一般消費財・サービス |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 40               | 105            | 96            | 7,804         | 金融         |
| GENTING SINGAPORE PLC        | —                | 450            | 42            | 3,453         | 一般消費財・サービス |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 120              | 277            | 103           | 8,392         | 電気通信サービス   |
| NOBLE GROUP LTD              | 38.18            | —              | —             | —             | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 40               | 40             | 13            | 1,066         | 資本財・サービス   |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 40               | 40             | 12            | 992           | 資本財・サービス   |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 90               | 90             | 3             | 312           | 生活必需品      |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 20               | 20             | 14            | 1,163         | 金融         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       | —                | 100            | 25            | 2,043         | 資本財・サービス   |
| STARHUB LTD                  | —                | 120            | 34            | 2,792         | 電気通信サービス   |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 50               | 50             | 18            | 1,470         | 生活必需品      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 40               | 40             | 9             | 798           | 不動産        |
| シンガポール・ドル<br>通 貨 計           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 707.18<br>17銘柄 | 1,701<br>18銘柄 | 717<br>57,962 | < 0.5%>    |
| (ニュージーランド)                   |                  | 百株             | 百株            | 千円            |            |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | —                | 150            | 39            | 3,234         | 公益事業       |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 112              | 56             | 20            | 1,665         | 電気通信サービス   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | —                | 31             | 20            | 1,634         | 資本財・サービス   |
| FLETCHER BUILDING LTD        | 19               | 19             | 19            | 1,604         | 素材         |
| ニュージーランド・ドル<br>通 貨 計         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 131<br>2銘柄     | 256<br>4銘柄    | 100<br>8,138  | < 0.1%>    |
| (イギリス)                       |                  | 百株             | 百株            | 千円            |            |
| MERLIN ENTERTAINMENT         | —                | 50             | 22            | 3,232         | 一般消費財・サービス |
| TUI AG-DI                    | 6                | 26             | 30            | 4,309         | 一般消費財・サービス |
| BP PLC                       | 255              | 569            | 292           | 41,147        | エネルギー      |
| UNILEVER PLC                 | 18               | 44.2           | 147           | 20,818        | 生活必需品      |
| BARCLAYS PLC                 | 246              | 537.5          | 125           | 17,716        | 金融         |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 25               | 45.5           | 30            | 4,235         | 資本財・サービス   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 32               | 32             | 10            | 1,521         | 一般消費財・サービス |
| RANDGOLD RESOURCES LTD       | 2                | 2              | 13            | 1,875         | 素材         |
| REXAM PLC                    | 10.28            | —              | —             | —             | その他        |
| PRUDENTIAL PLC               | 39               | 77.5           | 124           | 17,462        | 金融         |
| INMARSAT PLC                 | 12               | 12             | 9             | 1,339         | 電気通信サービス   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 51.7             | 151.7          | 34            | 4,858         | 金融         |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 3.3              | 3.3            | 10            | 1,481         | 素材         |
| BAE SYSTEMS PLC              | 49               | 85             | 50            | 7,152         | 資本財・サービス   |
| AVIVA PLC                    | 59.54            | 140.54         | 68            | 9,628         | 金融         |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 67               | 156.5          | 249           | 35,175        | ヘルスケア      |
| WORLDPAY GROUP PLC           | —                | 57             | 16            | 2,295         | 情報技術       |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | —                | 42             | 17            | 2,415         | 情報技術       |
| DCC PLC                      | —                | 1.5            | 9             | 1,310         | 資本財・サービス   |
| ROYAL MAIL PLC               | —                | 32.5           | 14            | 2,079         | 資本財・サービス   |
| RELX PLC                     | 21               | 37             | 53            | 7,581         | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 期 首    |          | 期 末                |              | 業 種 等      |
|------------------------------|--------|----------|--------------------|--------------|------------|
|                              | 株 数    | 株 数      | 評 価 額              |              |            |
|                              |        |          | 外貨建金額<br>千円(リス・ボド) | 邦貨換算金額<br>千円 |            |
|                              | 百株     | 百株       |                    |              |            |
| BG GROUP PLC                 | 50     | —        | —                  | —            | その他        |
| DIAGEO PLC                   | 36     | 79.5     | 172                | 24,289       | 生活必需品      |
| RIO TINTO PLC                | 17     | 37.5     | 117                | 16,545       | 素材         |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 47     | 104      | 72                 | 10,209       | 金融         |
| TESCO PLC                    | 142    | 237.5    | 47                 | 6,721        | 生活必需品      |
| FRESNILLO PLC                | 8      | 8        | 10                 | 1,543        | 素材         |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 11     | 24       | 29                 | 4,123        | ヘルスケア      |
| GLENCORE PLC                 | 156    | 376.5    | 112                | 15,837       | 素材         |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | —      | 15       | 19                 | 2,725        | 金融         |
| SMITHS GROUP PLC             | 9      | 9        | 13                 | 1,837        | 資本財・サービス   |
| BABCOCK INTL GROUP PLC       | 6      | 6        | 5                  | 782          | 資本財・サービス   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | —      | 47       | 17                 | 2,435        | 金融         |
| DIXONS CARPHONE PLC          | —      | 47       | 16                 | 2,254        | 一般消費財・サービス |
| PEARSON PLC                  | 15     | 15       | 12                 | 1,729        | 一般消費財・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC            | —      | 68.5     | 17                 | 2,458        | 生活必需品      |
| NEXT PLC                     | 1.5    | 6        | 24                 | 3,411        | 一般消費財・サービス |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 40     | 40       | 6                  | 954          | 一般消費財・サービス |
| WHITBREAD PLC                | 4      | 4        | 15                 | 2,177        | 一般消費財・サービス |
| IMI PLC                      | 4.75   | 4.75     | 5                  | 712          | 資本財・サービス   |
| BUNZL PLC                    | 9      | 9        | 18                 | 2,675        | 資本財・サービス   |
| GKN PLC                      | 26     | 26       | 8                  | 1,210        | 一般消費財・サービス |
| VODAFONE GROUP PLC           | 362.45 | 778.45   | 161                | 22,797       | 電気通信サービス   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 2      | 1.93     | 6                  | 890          | 素材         |
| KINGFISHER PLC               | 39     | 97       | 33                 | 4,745        | 一般消費財・サービス |
| WPP PLC                      | 16     | 40.5     | 75                 | 10,637       | 一般消費財・サービス |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 14.4   | 14.4     | 12                 | 1,821        | 公益事業       |
| SEVERN TRENT PLC             | 3      | 13       | 28                 | 4,053        | 公益事業       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 8      | 18.3     | 124                | 17,532       | 生活必需品      |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 6      | 27       | 28                 | 4,019        | 金融         |
| SCHRODERS PLC                | —      | 5.5      | 16                 | 2,348        | 金融         |
| TATE & LYLE PLC              | —      | 20       | 14                 | 1,973        | 生活必需品      |
| AMEC FOSTER WHEELER PLC      | 13     | —        | —                  | —            | エネルギー      |
| SSE PLC                      | 17     | 32       | 49                 | 6,931        | 公益事業       |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 2      | 13       | 25                 | 3,604        | 資本財・サービス   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 13     | 13       | 6                  | 907          | 一般消費財・サービス |
| ASTRAZENECA PLC              | 18     | 39       | 179                | 25,306       | ヘルスケア      |
| WOLSELEY PLC                 | 3.23   | 6.73     | 33                 | 4,735        | 資本財・サービス   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 69     | 230.5    | 57                 | 8,076        | 金融         |
| 3I GROUP PLC                 | 28     | 28       | 20                 | 2,860        | 金融         |
| SKY PLC                      | 13     | 41       | 40                 | 5,704        | 一般消費財・サービス |
| ASHTED GROUP PLC             | 12     | 12       | 18                 | 2,675        | 資本財・サービス   |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 23.79  | 23.79    | 15                 | 2,248        | 情報技術       |
| NATIONAL GRID PLC            | 50     | 107.5    | 102                | 14,392       | 公益事業       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 807.78 | 2,157.78 | 140                | 19,819       | 金融         |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 23.8   | 23.8     | 13                 | 1,925        | 金融         |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 13     | 29.5     | 106                | 15,024       | 生活必需品      |
| CENTRICA PLC                 | 78     | 168      | 38                 | 5,451        | 公益事業       |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | —      | 7        | 20                 | 2,829        | 一般消費財・サービス |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | —      | 5.5      | 15                 | 2,240        | 金融         |
| ARM HOLDINGS PLC             | 20     | —        | —                  | —            | その他        |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 26.55  | 57.55    | 269                | 37,889       | 生活必需品      |
| SABMILLER PLC                | 13     | —        | —                  | —            | その他        |
| BHP BILLITON PLC             | 35     | 65       | 87                 | 12,270       | 素材         |

| 銘 柄                          | 期 首              |                  | 当 期 末            |                  | 業 種 等              |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|
|                              | 株 数              | 株 数              | 評 価 額            |                  |                    |
|                              |                  |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額           |                    |
|                              | 百株               | 百株               | 千円               | 千円               |                    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 4                | 10.5             | 28               | 3,945            | 生活必需品              |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 280              | 620.5            | 415              | 58,451           | 金融                 |
| SHIRE PLC                    | 8                | 26.22            | 128              | 18,047           | ヘルスケア              |
| OLD MUTUAL PLC               | 77.12            | 197.12           | 41               | 5,779            | 金融                 |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 20               | 54               | 62               | 8,779            | 素材                 |
| MONDI PLC                    | 4                | 19               | 31               | 4,409            | 素材                 |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 57               | 57               | 13               | 1,905            | 生活必需品              |
| CARNIVAL PLC                 | 4                | 4                | 16               | 2,390            | 一般消費財・サービス         |
| COMPASS GROUP PLC            | 25.58            | 53.08            | 77               | 10,883           | 一般消費財・サービス         |
| PERSIMMON PLC                | 4                | 16               | 31               | 4,369            | 一般消費財・サービス         |
| BT GROUP PLC                 | 122              | 276              | 106              | 15,001           | 電気通信サービス           |
| BURBERRY GROUP PLC           | 7                | 21               | 31               | 4,439            | 一般消費財・サービス         |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 3.53             | 2.94             | 10               | 1,532            | 一般消費財・サービス         |
| AGGREKO PLC                  | 3.23             | —                | —                | —                | 資本財・サービス           |
| CAPITA PLC                   | 11               | 11               | 5                | 775              | 資本財・サービス           |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 3                | 3                | 4                | 622              | 資本財・サービス           |
| INTERTEK GROUP PLC           | 3                | 3                | 10               | 1,469            | 資本財・サービス           |
| ITV PLC                      | 54               | 151.5            | 31               | 4,427            | 一般消費財・サービス         |
| PETROFAC LTD                 | 9                | 9                | 8                | 1,175            | エネルギー              |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 6                | 13.5             | 39               | 5,562            | 金融                 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 59               | 133              | 299              | 42,237           | エネルギー              |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 34               | 120.27           | 281              | 39,701           | エネルギー              |
| MEGGITT PLC                  | —                | 35               | 15               | 2,208            | 資本財・サービス           |
| G4S PLC                      | 32               | 32               | 7                | 1,084            | 資本財・サービス           |
| COBHAM PLC                   | 34               | 34               | 5                | 788              | 資本財・サービス           |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 4                | 4                | 7                | 1,029            | 金融                 |
| INVESTEC PLC                 | 9                | 9                | 4                | 687              | 金融                 |
| ANTOFAGASTA PLC              | 7                | 7                | 4                | 694              | 素材                 |
| STANDARD LIFE PLC            | 27.09            | 92.09            | 33               | 4,675            | 金融                 |
| EXPERIAN PLC                 | 15               | 28               | 44               | 6,226            | 資本財・サービス           |
| イギリス・ボンド<br>通 貨 計            | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 4,135.62<br>90銘柄 | 9,386.44<br>98銘柄 | 5,618<br>< 6.4%> | 791,288<br>< 6.4%> |
| (イスラエル)                      |                  | 百株               | 百株               | 千イスラエル・<br>シェケル  | 千円                 |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 50               | 50               | 35               | 1,057            | 電気通信サービス           |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | —                | 3                | 118              | 3,575            | 資本財・サービス           |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD  | 15               | —                | —                | —                | ヘルスケア              |
| BANK HAPOLALIM BM            | —                | 34               | 79               | 2,409            | 金融                 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 48               | 48               | 75               | 2,275            | 金融                 |
| NICE LTD                     | 2                | 2                | 53               | 1,604            | 情報技術               |
| イスラエル・シェケル<br>通 貨 計          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 115<br>4銘柄       | 137<br>5銘柄       | 362<br>< 0.1%>   | 10,923             |
| (スイス)                        |                  | 百株               | 百株               | 千スイス・フラン         | 千円                 |
| DUFREY AG-REG                | —                | 1.5              | 19               | 2,225            | 一般消費財・サービス         |
| UBS GROUP AG-REG             | 62               | 125.5            | 210              | 24,113           | 金融                 |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | —                | 0.5              | 26               | 2,993            | 素材                 |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 2                | 3.5              | 24               | 2,776            | 資本財・サービス           |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 11.2             | 24.1             | 582              | 66,675           | ヘルスケア              |
| SIKA AG-BR                   | 0.05             | 0.1              | 48               | 5,504            | 素材                 |
| ABB LTD-REG                  | 34               | 68               | 148              | 16,993           | 資本財・サービス           |
| ARYZTA AG                    | 2                | 2                | 8                | 1,025            | 生活必需品              |
| TRANSOCEAN LTD               | 7                | —                | —                | —                | エネルギー              |
| SWISS RE AG                  | 6                | 11.5             | 110              | 12,633           | 金融                 |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期 首              |                | 当 期 末           |                             | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|----------------|-----------------|-----------------------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数            | 評 価 額           |                             |            |
|                              |                  |                | 外貨建金額           | 邦貨換算金額                      |            |
|                              | 百株               | 百株             | 千円              |                             |            |
| NESTLE SA-REG                | 51               | 106            | 791             | 90,560                      | 生活必需品      |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | —                | 0.5            | 24              | 2,773                       | 金融         |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 0.5              | 1.5            | 26              | 3,070                       | 資本財・サービス   |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 27.31            | 72.31          | 115             | 13,157                      | 金融         |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 5                | 5              | 23              | 2,699                       | 金融         |
| SGS SA-REG                   | 0.07             | 0.17           | 35              | 4,110                       | 資本財・サービス   |
| GALENICA AG-REG              | —                | 0.12           | 14              | 1,623                       | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 0.5              | 1              | 32              | 3,672                       | 一般消費財・サービス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 2.5              | 5.3            | 150             | 17,251                      | 金融         |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 1                | 1              | 13              | 1,491                       | 金融         |
| NOVARTIS AG-REG              | 36.5             | 75.3           | 564             | 64,590                      | ヘルスケア      |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 9                | 16.5           | 112             | 12,870                      | 一般消費財・サービス |
| SWISSCOM AG-REG              | 0.5              | 1.2            | 55              | 6,398                       | 電気通信サービス   |
| GEBERIT AG-REG               | 0.5              | 1              | 40              | 4,685                       | 資本財・サービス   |
| GIVAUDAN-REG                 | 0.2              | 0.35           | 65              | 7,465                       | 素材         |
| ACTELION LTD-REG             | 2                | 4              | 91              | 10,416                      | ヘルスケア      |
| SYNGENTA AG-REG              | 1.5              | 3.4            | 140             | 16,106                      | 素材         |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 1                | 1              | 12              | 1,413                       | ヘルスケア      |
| LONZA GROUP AG-REG           | 1                | 2.5            | 45              | 5,252                       | ヘルスケア      |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 7.2              | 16.7           | 89              | 10,247                      | 素材         |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 0.5              | 1.5            | 44              | 5,096                       | 金融         |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   | 1                | 1              | 13              | 1,550                       | 資本財・サービス   |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 1                | 4.5            | 38              | 4,348                       | 不動産        |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | —                | 0.03           | 16              | 1,892                       | 生活必需品      |
| スイス・フラン<br>通 貨 計             | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 274.03<br>29銘柄 | 558.58<br>33銘柄  | 3,739<br>427,685<br>< 3.5%> |            |
| (デンマーク)                      | 百株               | 百株             | 千デンマーク・<br>クローネ | 千円                          |            |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 32               | 67.5           | 1,728           | 28,557                      | ヘルスケア      |
| DANSKE BANK A/S              | 14               | 24             | 521             | 8,615                       | 金融         |
| ISS A/S                      | —                | 6              | 143             | 2,366                       | 資本財・サービス   |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 0.1              | 0.1            | 113             | 1,879                       | 資本財・サービス   |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 3                | 6              | 283             | 4,676                       | 資本財・サービス   |
| TDC A/S                      | 13               | 13             | 47              | 782                         | 電気通信サービス   |
| CARLSBERG AS-B               | 2                | 5.5            | 338             | 5,587                       | 生活必需品      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 5                | 5              | 126             | 2,090                       | 素材         |
| COLOPLAST-B                  | 2                | 6.5            | 315             | 5,219                       | ヘルスケア      |
| DSV A/S                      | 6                | 6              | 192             | 3,171                       | 資本財・サービス   |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 0.1              | 0.26           | 311             | 5,145                       | 資本財・サービス   |
| PANDORA A/S                  | 1.5              | 3              | 262             | 4,329                       | 一般消費財・サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | —                | 3.5            | 138             | 2,291                       | 素材         |
| GENMAB A/S                   | —                | 1.5            | 193             | 3,196                       | ヘルスケア      |
| DONG ENERGY A/S              | —                | 8              | 208             | 3,445                       | 公益事業       |
| デンマーク・クローネ<br>通 貨 計          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 78.7<br>11銘柄   | 155.86<br>15銘柄  | 4,924<br>81,357<br>< 0.7%>  |            |
| (ノルウェー)                      | 百株               | 百株             | 千ノルウェー・<br>クローネ | 千円                          |            |
| NORSK HYDRO ASA              | 27               | 27             | 112             | 1,526                       | 素材         |
| DNB ASA                      | 16               | 30             | 398             | 5,414                       | 金融         |
| ORKLA ASA                    | 12               | 42             | 325             | 4,423                       | 生活必需品      |
| TELENOR ASA                  | 13               | 29             | 391             | 5,320                       | 電気通信サービス   |
| STATOIL ASA                  | 18               | 43.5           | 691             | 9,386                       | エネルギー      |

| 銘柄                           | 期 首              |             | 期 末          |                  | 業 種 等              |            |
|------------------------------|------------------|-------------|--------------|------------------|--------------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数         | 評 価 額        |                  |                    |            |
|                              |                  |             | 外貨建金額        | 邦貨換算金額           |                    |            |
|                              |                  | 百株          | 百株           | 千/ルウェー・<br>クローネ  | 千円                 |            |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 2                | 8.5         |              | 299              | 4,063              | 素材         |
| MARINE HARVEST               | —                | 8.5         |              | 123              | 1,679              | 生活必需品      |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          | 5                | 5           |              | 94               | 1,279              | 一般消費財・サービス |
| ノルウェー・クローネ<br>通 貨 計          | 株数、金額<br>総額換<比率> | 93<br>7銘柄   | 193.5<br>8銘柄 | 2,436<br>8銘柄     | 33,094<br>< 0.3%>  |            |
| (スウェーデン)                     |                  | 百株          | 百株           | 千スウェーデン・<br>クローネ | 千円                 |            |
| ERICSSON LM-B SHS            | 47               | 81          |              | 433              | 5,565              | 情報技術       |
| VOLVO AB-B SHS               | 22               | 63          |              | 686              | 8,802              | 資本財・サービス   |
| MILICOM INTL CELLULAR-SDR    | 2                | 2           |              | 83               | 1,076              | 電気通信サービス   |
| SKF AB-B SHARES              | 7                | 7           |              | 118              | 1,515              | 資本財・サービス   |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 3                | 15          |              | 330              | 4,245              | 一般消費財・サービス |
| NORDEA BANK AB               | 55               | 102         |              | 1,015            | 13,034             | 金融         |
| SWEDISH MATCH AB             | 3                | 3           |              | 87               | 1,119              | 生活必需品      |
| TELE2 AB-B SHS               | 3                | 3           |              | 21               | 282                | 電気通信サービス   |
| GETINGE AB-B SHS             | 2                | 2           |              | 29               | 380                | ヘルスケア      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 26               | 49          |              | 466              | 5,988              | 金融         |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 20               | 60          |              | 738              | 9,468              | 金融         |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 15               | 34          |              | 731              | 9,383              | 金融         |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 14               | 35          |              | 861              | 11,055             | 一般消費財・サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 11               | 18          |              | 457              | 5,865              | 生活必需品      |
| SKANSKA AB-B SHS             | 6                | 18          |              | 382              | 4,912              | 資本財・サービス   |
| SANDVIK AB                   | 20               | 45          |              | 513              | 6,581              | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            | 6                | 12          |              | 409              | 5,259              | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 8                | 24          |              | 679              | 8,720              | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           | 5                | 5           |              | 72               | 929                | 資本財・サービス   |
| TELIA CO AB                  | 36               | 84          |              | 312              | 4,014              | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                | 4                | 4           |              | 61               | 786                | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 5                | 16          |              | 405              | 5,205              | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              | 18               | 41          |              | 681              | 8,742              | 資本財・サービス   |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 8                | 8           |              | 153              | 1,973              | エネルギー      |
| BOLIDEN AB                   | 8                | 8           |              | 191              | 2,458              | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | —                | 24          |              | 168              | 2,161              | 一般消費財・サービス |
| KINNEVIK AB - B              | 5                | 5           |              | 111              | 1,425              | 金融         |
| HEXAGON AB-B SHS             | 4                | 10          |              | 342              | 4,398              | 情報技術       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | —                | 13          |              | 215              | 2,760              | 金融         |
| スウェーデン・クローネ<br>通 貨 計         | 株数、金額<br>総額換<比率> | 363<br>27銘柄 | 791<br>29銘柄  | 10,764<br>29銘柄   | 138,113<br>< 1.1%> |            |
| ユーロ (アイルランド)                 |                  | 百株          | 百株           | 千ユーロ             | 千円                 |            |
| BANK OF IRELAND              | 270              | 1,570       |              | 39               | 4,799              | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            | 3                | 5.5         |              | 38               | 4,679              | 生活必需品      |
| CRH PLC                      | 14               | 26.5        |              | 84               | 10,428             | 素材         |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      | —                | 2           |              | 20               | 2,509              | 一般消費財・サービス |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>総額換<比率> | 287<br>3銘柄  | 1,604<br>4銘柄 | 182<br>4銘柄       | 22,416<br>< 0.2%>  |            |
| ユーロ (オランダ)                   |                  | 百株          | 百株           | 千ユーロ             | 千円                 |            |
| QIAGEN N.V.                  | 4                | 4           |              | 10               | 1,333              | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 11               | 32.5        |              | 93               | 11,446             | 資本財・サービス   |
| NN GROUP NV                  | —                | 7           |              | 22               | 2,820              | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              | 24               | 47          |              | 183              | 22,537             | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  | 3                | 8.6         |              | 61               | 7,524              | 生活必需品      |

| 銘柄                            | 株数               | 株数             | 期末             |                             | 業種等        |
|-------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------------------|------------|
|                               |                  |                | 評価額            | 額                           |            |
|                               |                  |                |                |                             |            |
|                               | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| RELX NV                       | 18.45            | 32.45          | 51             | 6,310                       | 資本財・サービス   |
| AEGON NV                      | 26               | 86             | 44             | 5,456                       | 金融         |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 18.23            | 37.24          | 73             | 9,018                       | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                    | 5                | 10             | 59             | 7,338                       | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV            | 3                | 6              | 35             | 4,318                       | 素材         |
| WOLTERS KLUWER                | 9                | 9.5            | 33             | 4,061                       | 資本財・サービス   |
| BOSKALIS WESTMINSTER          | 1                | 1              | 3              | 406                         | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV                  | 56               | 115            | 157            | 19,351                      | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV            | 56               | 56             | 15             | 1,956                       | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV               | 5.5              | 12.4           | 131            | 16,191                      | 情報技術       |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA         | —                | 13             | 28             | 3,509                       | 金融         |
| RANDSTAD HOLDING NV           | 3                | 3              | 16             | 1,993                       | 資本財・サービス   |
| HEINEKEN HOLDING NV           | 2                | 2              | 13             | 1,627                       | 生活必需品      |
| GEMALTO                       | 2                | 2              | 11             | 1,356                       | 情報技術       |
| ALTICE NV - A                 | 3                | 13.5           | 25             | 3,117                       | 一般消費財・サービス |
| ALTICE NV - B                 | 1                | 1              | 1              | 231                         | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS SE                     | 9                | 17.5           | 114            | 14,026                      | 資本財・サービス   |
| EXOR NV                       | —                | 4.5            | 19             | 2,371                       | 金融         |
| CNH INDUSTRIAL NV             | 14               | 46.5           | 38             | 4,730                       | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV  | 10               | 42             | 42             | 5,177                       | 一般消費財・サービス |
| FERRARI NV                    | 1                | 4.5            | 24             | 3,041                       | 一般消費財・サービス |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 285.18<br>23銘柄 | 614.19<br>26銘柄 | 1,313<br>161,257<br>< 1.3%> |            |
| ユーロ (ベルギー)                    | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| UCB SA                        | 3                | 3              | 19             | 2,418                       | ヘルスケア      |
| KBC GROEP NV                  | 5                | 9.5            | 56             | 6,985                       | 金融         |
| COLRUYT SA                    | —                | 3.5            | 16             | 2,002                       | 生活必需品      |
| DELHAIZE GROUP                | 1.5              | —              | —              | —                           | その他        |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   | 1                | 4              | 31             | 3,887                       | 金融         |
| SOLVAY SA                     | 1                | 3              | 33             | 4,055                       | 素材         |
| UMICORE                       | 2                | 2              | 10             | 1,337                       | 素材         |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    | 11.5             | 24.2           | 242            | 29,727                      | 生活必需品      |
| AGEAS                         | 3                | 3              | 11             | 1,414                       | 金融         |
| PROXIMUS                      | —                | 7              | 19             | 2,389                       | 電気通信サービス   |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 28<br>8銘柄      | 59.2<br>9銘柄    | 441<br>54,219<br>< 0.4%>    |            |
| ユーロ (ルクセンブルグ)                 | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| ARCELORMITTAL                 | 12               | 56             | 40             | 4,966                       | 素材         |
| EUROFINS SCIENTIFIC           | —                | 0.6            | 25             | 3,084                       | ヘルスケア      |
| SES                           | 6                | 19             | 40             | 4,914                       | 一般消費財・サービス |
| TENARIS SA                    | 6                | 22             | 37             | 4,570                       | エネルギー      |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 24<br>3銘柄      | 97.6<br>4銘柄    | 142<br>17,535<br>< 0.1%>    |            |
| ユーロ (フランス)                    | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| TOTAL SA                      | 32               | 67.5           | 324            | 39,851                      | エネルギー      |
| MICHELIN (CGDE)               | 2                | 6.5            | 68             | 8,439                       | 一般消費財・サービス |
| AIR LIQUIDE SA                | 5.15             | 12.79          | 133            | 16,441                      | 素材         |
| KERING                        | 1                | 3.2            | 69             | 8,500                       | 一般消費財・サービス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE         | 8                | 19             | 126            | 15,499                      | 資本財・サービス   |
| BOUYGUES SA                   | 5                | 5              | 16             | 2,082                       | 資本財・サービス   |
| BNP PARIBAS                   | 16.5             | 34.5           | 211            | 25,919                      | 金融         |
| PEUGEOT SA                    | 11               | 11             | 18             | 2,237                       | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           | 期 首              | 当              | 期 末            |                             | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数            | 評 価 額          |                             |            |
|                              |                  |                | 外貨建金額          | 邦貨換算金額                      |            |
|                              | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| NATIXIS                      | 30               | 30             | 16             | 2,006                       | 金融         |
| THALES SA                    | 1                | 3              | 27             | 3,315                       | 資本財・サービス   |
| DANONE                       | 8                | 18.5           | 113            | 13,967                      | 生活必需品      |
| CARREFOUR SA                 | 11               | 22             | 50             | 6,165                       | 生活必需品      |
| SUEZ                         | 1.5              | 9.5            | 13             | 1,621                       | 公益事業       |
| VIVENDI                      | 17.96            | 27.46          | 50             | 6,161                       | 一般消費財・サービス |
| L'OREAL                      | 4                | 7.9            | 135            | 16,620                      | 生活必需品      |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 7                | 16.5           | 74             | 9,091                       | 資本財・サービス   |
| LEGRAND SA                   | 4                | 8.5            | 45             | 5,612                       | 資本財・サービス   |
| ALCATEL-LUCENT SA            | 40               | —              | —              | —                           | その他        |
| CASINO GUICHARD PERRACHON    | 2                | 2              | 9              | 1,183                       | 生活必需品      |
| PERNOD RICARD SA             | 3.6              | 8.1            | 85             | 10,447                      | 生活必需品      |
| SOCIETE BIC SA               | —                | 1.5            | 19             | 2,365                       | 資本財・サービス   |
| EURAZEO                      | —                | 5              | 28             | 3,456                       | 金融         |
| REXEL SA                     | —                | 16             | 25             | 3,189                       | 資本財・サービス   |
| SOCIETE GENERALE SA          | 11               | 23.5           | 108            | 13,331                      | 金融         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 4                | 9.3            | 168            | 20,661                      | 一般消費財・サービス |
| ACCOR SA                     | 3                | 3              | 11             | 1,402                       | 一般消費財・サービス |
| CAPGEMINI                    | 3                | 6              | 48             | 5,950                       | 情報技術       |
| VALEO SA                     | 1                | 6.5            | 35             | 4,358                       | 一般消費財・サービス |
| PUBLICIS GROUPE              | 2.5              | 5              | 33             | 4,113                       | 一般消費財・サービス |
| BUREAU VERITAS SA            | 4                | 4              | 7              | 931                         | 資本財・サービス   |
| EIFFAGE                      | —                | 4              | 27             | 3,322                       | 資本財・サービス   |
| SODEXO                       | 2                | 2              | 21             | 2,679                       | 一般消費財・サービス |
| INGENICO GROUP               | —                | 2              | 15             | 1,899                       | 情報技術       |
| ZODIAC AEROSPACE             | —                | 8              | 18             | 2,249                       | 資本財・サービス   |
| ESSILOR INTERNATIONAL        | 3                | 7              | 73             | 9,045                       | ヘルスケア      |
| AXA SA                       | 28               | 57.5           | 141            | 17,377                      | 金融         |
| CHRISTIAN DIOR SE            | 1                | 2.5            | 49             | 6,057                       | 一般消費財・サービス |
| TECHNIP SA                   | 2                | 2              | 13             | 1,679                       | エネルギー      |
| EDENRED                      | 8                | 8              | 15             | 1,916                       | 資本財・サービス   |
| RENAULT SA                   | 3                | 6              | 51             | 6,314                       | 一般消費財・サービス |
| HERMES INTERNATIONAL         | 0.32             | 0.82           | 32             | 3,940                       | 一般消費財・サービス |
| ATOS SE                      | 2                | 2              | 20             | 2,524                       | 情報技術       |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 2.5              | 6              | 44             | 5,404                       | 情報技術       |
| ORANGE                       | 25               | 66.5           | 98             | 12,067                      | 電気通信サービス   |
| ALSTOM                       | 3.1              | 3.1            | 8              | 1,005                       | 資本財・サービス   |
| SANOFI                       | 17.5             | 36             | 279            | 34,264                      | ヘルスケア      |
| VINCI SA                     | 6                | 17             | 112            | 13,775                      | 資本財・サービス   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 10               | 25             | 39             | 4,812                       | 公益事業       |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 12               | 38.5           | 46             | 5,731                       | 金融         |
| ENGIE                        | 22.89            | 56.39          | 67             | 8,342                       | 公益事業       |
| SAFRAN SA                    | 4.5              | 11.5           | 77             | 9,546                       | 資本財・サービス   |
| ILIAD SA                     | —                | 1              | 18             | 2,290                       | 電気通信サービス   |
| ARKEMA                       | 2                | 2              | 18             | 2,265                       | 素材         |
| ADP                          | 1                | 1              | 10             | 1,243                       | 資本財・サービス   |
| SCOR SE                      | 6                | 6              | 19             | 2,376                       | 金融         |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR  | 11               | 11             | 10             | 1,241                       | 資本財・サービス   |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 412.02<br>49銘柄 | 775.56<br>55銘柄 | 3,406<br>418,303<br>< 3.4%> |            |
| ユーロ (ドイツ)                    | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| BAYER AG-REG                 | 11.5             | 25             | 254            | 31,216                      | ヘルスケア      |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                                                       | 期 首              |                | 当 期 末          |                             | 業 種 等      |
|----------------------------------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------------------|------------|
|                                                          | 株 数              | 株 数            | 評 価 額          |                             |            |
|                                                          |                  |                | 外貨建金額          | 邦貨換算金額                      |            |
|                                                          | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| EVONIK INDUSTRIES AG                                     | －                | 6              | 16             | 2,027                       | 素材         |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED                              | 19               | 48.5           | 87             | 10,778                      | 金融         |
| COMMERZBANK AG                                           | 14.9             | 49.9           | 38             | 4,693                       | 金融         |
| VOLKSWAGEN AG                                            | 0.5              | 0.5            | 7              | 908                         | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                                       | 2.5              | 6              | 87             | 10,744                      | 一般消費財・サービス |
| MAN SE                                                   | 1                | 1              | 9              | 1,171                       | 資本財・サービス   |
| SIEMENS AG-REG                                           | 11               | 24             | 278            | 34,196                      | 資本財・サービス   |
| E.ON SE                                                  | 29.5             | 55.5           | 36             | 4,526                       | 公益事業       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG                              | 5.5              | 11             | 98             | 12,132                      | 一般消費財・サービス |
| GEA GROUP AG                                             | 2                | 5.5            | 20             | 2,546                       | 資本財・サービス   |
| OSRAM LICHT AG                                           | 1.45             | 1.45           | 7              | 887                         | 資本財・サービス   |
| CONTINENTAL AG                                           | 2                | 3.3            | 61             | 7,572                       | 一般消費財・サービス |
| BASF SE                                                  | 13.5             | 28.4           | 248            | 30,566                      | 素材         |
| LINDE AG                                                 | 3                | 7              | 108            | 13,338                      | 素材         |
| K+S AG-REG                                               | 3                | 3              | 6              | 827                         | 素材         |
| ALLIANZ SE-REG                                           | 7                | 14.6           | 234            | 28,735                      | 金融         |
| THYSSENKRUPP AG                                          | 5                | 15.5           | 34             | 4,280                       | 素材         |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG                               | 3                | 7              | 79             | 9,815                       | 生活必需品      |
| RWE AG                                                   | 4                | 16.5           | 19             | 2,390                       | 公益事業       |
| BRENNTAG AG                                              | 3                | 8              | 41             | 5,105                       | 資本財・サービス   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA                                   | 5                | 11             | 79             | 9,782                       | ヘルスケア      |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE                             | －                | 4              | 15             | 1,890                       | 情報技術       |
| SAP SE                                                   | 13               | 28.5           | 240            | 29,512                      | 情報技術       |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG                               | 2                | 4.5            | 79             | 9,801                       | 金融         |
| HEIDELBERGCEMENT AG                                      | 3                | 6              | 51             | 6,328                       | 素材         |
| COVESTRO AG                                              | －                | 4              | 24             | 3,048                       | 素材         |
| INNOGY SE                                                | －                | 6              | 18             | 2,328                       | 公益事業       |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF                               | 3                | 8              | 44             | 5,417                       | 一般消費財・サービス |
| BEIERSDORF AG                                            | 2                | 5              | 40             | 4,958                       | 生活必需品      |
| MERCK KGAA                                               | 3                | 5.7            | 58             | 7,159                       | ヘルスケア      |
| ADIDAS AG                                                | 4                | 6.2            | 89             | 10,999                      | 一般消費財・サービス |
| HENKEL AG & CO KGAA                                      | 2                | 4              | 39             | 4,842                       | 生活必需品      |
| METRO AG                                                 | 5                | 5              | 15             | 1,918                       | 生活必需品      |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG                                  | 46               | 95             | 155            | 19,117                      | 電気通信サービス   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 4.5              | 7.5            | 56             | 6,916                       | ヘルスケア      |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG                                 | 14               | 31.1           | 223            | 27,485                      | 一般消費財・サービス |
| HANNOVER RUECK SE                                        | 14               | 41             | 66             | 8,205                       | 情報技術       |
| DEUTSCHE POST AG-REG                                     | 1                | 1              | 10             | 1,257                       | 金融         |
| DEUTSCHE BOERSE AG                                       | 11               | 27             | 85             | 10,480                      | 資本財・サービス   |
| DEUTSCHE BOERSE AG                                       | 4                | －              | －              | －                           | 金融         |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER                                | －                | 7              | 54             | 6,699                       | 金融         |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE                                  | 3                | 9              | 34             | 4,230                       | 一般消費財・サービス |
| LANXESS AG                                               | 2                | 2              | 12             | 1,595                       | 素材         |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR                                    | 7                | 15.8           | 47             | 5,883                       | 不動産        |
| SYMRISE AG                                               | －                | 4              | 23             | 2,829                       | 素材         |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG                             | 1                | －              | －              | －                           | 一般消費財・サービス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF                             | －                | 2.5            | 18             | 2,256                       | 一般消費財・サービス |
| HUGO BOSS AG -ORD                                        | －                | 3.5            | 19             | 2,435                       | 一般消費財・サービス |
| VONOVIA SE                                               | 6                | 11.5           | 35             | 4,380                       | 不動産        |
| 国 小 計                                                    | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 297.85<br>42銘柄 | 693.45<br>48銘柄 | 3,422<br>420,227<br>< 3.4%> |            |

| 銘 柄                           | 期 首              |                | 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（ポルトガル）                    | 百株               | 百株             | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| JERONIMO MARTINS              | 8                | 8              | 12               | 1,570                       | 生活必需品      |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA   | 57               | 57             | 15               | 1,955                       | 公益事業       |
| GALP ENERGIA SGPS SA          | —                | 18             | 25               | 3,132                       | エネルギー      |
| 国 小 計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 65<br>2銘柄      | 83<br>3銘柄        | 54<br>6,658<br>< 0.1%>      |            |
| ユーロ（スペイン）                     | 百株               | 百株             | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| TELEFONICA SA                 | 74               | 148            | 135              | 16,674                      | 電気通信サービス   |
| ENDESA SA                     | —                | 9              | 18               | 2,213                       | 公益事業       |
| BANCO POPULAR ESPANOL         | 32.41            | 32.41          | 3                | 397                         | 金融         |
| BANCO POPULAR ESPANOL-RTS     | 32.41            | —              | —                | —                           | その他        |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA  | 93.9             | 197.89         | 129              | 15,882                      | 金融         |
| IBERDROLA SA                  | 77.35            | 156.06         | 94               | 11,548                      | 公益事業       |
| BANCO DE SABADELL SA          | 54.14            | 145.87         | 20               | 2,466                       | 金融         |
| BANKINTER SA                  | —                | 27             | 20               | 2,486                       | 金融         |
| REPSOL SA                     | 13               | 28             | 37               | 4,665                       | エネルギー      |
| GRIFOLS SA                    | 4                | 4              | 7                | 956                         | ヘルスケア      |
| BANCO SANTANDER SA            | 212              | 428.5          | 219              | 26,936                      | 金融         |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA   | 12               | 32.6           | 44               | 5,493                       | 資本財・サービス   |
| AMADEUS IT GROUP SA           | 9                | 14             | 61               | 7,514                       | 情報技術       |
| GAS NATURAL SDG SA            | 6                | 6              | 10               | 1,292                       | 公益事業       |
| CAIXABANK S.A                 | 63               | 143.87         | 47               | 5,816                       | 金融         |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-EDI | —                | 49             | 26               | 3,242                       | 資本財・サービス   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV   | 3                | 3              | 9                | 1,106                       | 資本財・サービス   |
| AENA SA                       | —                | 2              | 26               | 3,253                       | 資本財・サービス   |
| IBERDROLA SA-RTS              | —                | 156.06         | 2                | 256                         | その他        |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL    | 14.5             | 37.5           | 119              | 14,671                      | 一般消費財・サービス |
| ENAGAS SA                     | 8                | 8              | 19               | 2,358                       | 公益事業       |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA  | 2                | 23             | 39               | 4,878                       | 公益事業       |
| FERROVIAL SA                  | 9                | 26             | 47               | 5,773                       | 資本財・サービス   |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL   | —                | 32             | 15               | 1,862                       | 生活必需品      |
| BANKIA SA                     | 50               | 50             | 5                | 626                         | 金融         |
| 国 小 計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 769.71<br>19銘柄 | 1,759.76<br>24銘柄 | 1,159<br>142,375<br>< 1.2%> |            |
| ユーロ（イタリア）                     | 百株               | 百株             | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| BANCO POPOLARE SC             | 5                | —              | —                | —                           | その他        |
| PRYSMIAN SPA                  | 4                | 4              | 9                | 1,176                       | 資本財・サービス   |
| ASSICURAZIONI GENERALI        | 13.11            | 40.11          | 56               | 6,963                       | 金融         |
| MEDIOBANCA SPA                | 11.6             | 11.6           | 9                | 1,113                       | 金融         |
| UNICREDIT SPA                 | 68.33            | 149.33         | 39               | 4,902                       | 金融         |
| TELECOM ITALIA SPA            | 148              | 298            | 24               | 3,007                       | 電気通信サービス   |
| TELECOM ITALIA-RSP            | 97               | 97             | 6                | 807                         | 電気通信サービス   |
| INTESA SANPAOLO               | 192              | 399.5          | 98               | 12,144                      | 金融         |
| ATLANTIA SPA                  | 6.77             | 14.77          | 33               | 4,060                       | 資本財・サービス   |
| POSTE ITALIANE SPA            | —                | 29             | 17               | 2,195                       | 金融         |
| ENI SPA                       | 39               | 72             | 110              | 13,605                      | エネルギー      |
| LEONARDO SPA                  | 5                | 5              | 6                | 823                         | 資本財・サービス   |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA  | 50.19            | —              | —                | —                           | その他        |
| ENEL SPA                      | 108              | 248            | 102              | 12,642                      | 公益事業       |
| SNAM SPA                      | 41               | 89             | 34               | 4,220                       | エネルギー      |
| LUXOTTICA GROUP SPA           | 3                | 8              | 37               | 4,642                       | 一般消費財・サービス |
| UBI BANCA SPA                 | 20               | —              | —                | —                           | 金融         |

| 銘柄                          |                  | 期 首                  |                      | 期 末        |                       | 業 種 等      |
|-----------------------------|------------------|----------------------|----------------------|------------|-----------------------|------------|
|                             |                  | 株 数                  | 株 数                  | 評 価 額      | 評 価 額                 |            |
|                             |                  |                      |                      | 外貨建金額      | 邦貨換算金額                |            |
| TERNA SPA                   |                  | 百株<br>37             | 百株<br>37             | 千ユーロ<br>15 | 千円<br>1,963           | 公益事業       |
| 国 小 計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 849<br>17銘柄          | 1,502.31<br>15銘柄     | 604        | 74,268<br>< 0.6%>     |            |
| ユーロ（フィンランド）                 |                  | 百株                   | 百株                   | 千ユーロ       | 千円                    |            |
| UPM-KYMMENE OYJ             |                  | 8                    | 20.5                 | 47         | 5,846                 | 素材         |
| NOKIA OYJ                   |                  | 57                   | 161                  | 73         | 9,045                 | 情報技術       |
| WARTSILA OYJ ABP            |                  | 3                    | 3                    | 12         | 1,568                 | 資本財・サービス   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        |                  | －                    | 20                   | 20         | 2,465                 | 素材         |
| METSO OYJ                   |                  | 3                    | 3                    | 8          | 1,009                 | 資本財・サービス   |
| ELISA OYJ                   |                  | 2.5                  | 2.5                  | 7          | 963                   | 電気通信サービス   |
| SAMPO OYJ-A SHS             |                  | 7                    | 11                   | 48         | 5,952                 | 金融         |
| FORTUM OYJ                  |                  | 7                    | 7                    | 10         | 1,275                 | 公益事業       |
| KONE OYJ-B                  |                  | 6                    | 13                   | 55         | 6,863                 | 資本財・サービス   |
| NOKIAN RENKAAT OYJ          |                  | －                    | 7                    | 25         | 3,149                 | 一般消費財・サービス |
| NESTE OYJ                   |                  | 4                    | 4                    | 13         | 1,615                 | エネルギー      |
| ORION OYJ-CLASS B           |                  | －                    | 5                    | 21         | 2,671                 | ヘルスケア      |
| 国 小 計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 97.5<br>9銘柄          | 257<br>12銘柄          | 345        | 42,425<br>< 0.3%>     |            |
| ユーロ（オーストリア）                 |                  | 百株                   | 百株                   | 千ユーロ       | 千円                    |            |
| OMV AG                      |                  | 6                    | 6                    | 20         | 2,508                 | エネルギー      |
| ERSTE GROUP BANK AG         |                  | 4                    | 10.5                 | 30         | 3,775                 | 金融         |
| VOESTALPINE AG              |                  | 2                    | 8                    | 29         | 3,613                 | 素材         |
| 国 小 計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12<br>3銘柄            | 24.5<br>3銘柄          | 80         | 9,897<br>< 0.1%>      |            |
| ユーロ（その他）                    |                  | 百株                   | 百株                   | 千ユーロ       | 千円                    |            |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS |                  | －                    | 5                    | 15         | 1,858                 | 生活必需品      |
| STMICROELECTRONICS NV       |                  | 12                   | 12                   | 12         | 1,547                 | 情報技術       |
| 国 小 計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12<br>1銘柄            | 17<br>2銘柄            | 27         | 3,406<br>< 0.0%>      |            |
| ユーロ通貨計                      | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,139.26<br>179銘柄    | 7,487.57<br>205銘柄    | 11,182     | 1,372,990<br><11.2%>  |            |
| ファンド合計                      | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 16,929.03<br>1,035銘柄 | 37,223.84<br>1,175銘柄 | －          | 11,208,630<br><91.1%> |            |

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 投資信託証券

| 銘柄                           | 期首               |                | 期末             |                 |
|------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------|
|                              | 口数               | 口数             | 評価額            |                 |
|                              |                  |                | 外貨建金額          | 邦貨換算金額          |
| (アメリカ)                       | 千口               | 千口             | 千アメリカ・ドル       | 千円              |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 0.222            | 0.372          | 65             | 7,644           |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 0.444            | 0.934          | 173            | 20,135          |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.3              | 0.55           | 71             | 8,306           |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES    | 0.8              | 1.7            | 43             | 5,036           |
| VORNADO REALTY TRUST         | 0.356            | 0.606          | 64             | 7,453           |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 0.6              | 1              | 64             | 7,475           |
| EQUINIX INC                  | 0.104            | 0.234          | 87             | 10,126          |
| AMERICAN TOWER CORP          | 0.6              | 1.3            | 136            | 15,831          |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 1.328            | 2.728          | 49             | 5,757           |
| KIMCO REALTY CORP            | 0.6              | 1.8            | 46             | 5,337           |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | —                | 0.35           | 10             | 1,190           |
| PLUM CREEK TIMBER CO         | 0.4              | —              | —              | —               |
| VENTAS INC                   | 0.5              | 1.25           | 79             | 9,197           |
| WEYERHAEUSER CO              | 0.864            | 2.504          | 77             | 8,992           |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 0.7              | 0.7            | 13             | 1,531           |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | —                | 1.4            | 34             | 3,993           |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 0.45             | 1.15           | 98             | 11,432          |
| IRON MOUNTAIN INC            | 0.218            | 0.918          | 30             | 3,540           |
| VEREIT INC                   | 1.2              | 4.35           | 38             | 4,418           |
| PROLOGIS INC                 | 0.665            | 1.465          | 78             | 9,122           |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | —                | 0.2            | 22             | 2,575           |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | —                | 0.3            | 25             | 2,922           |
| DUKE REALTY CORP             | —                | 0.8            | 21             | 2,493           |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.1              | 0.25           | 57             | 6,688           |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 0.2              | 0.25           | 35             | 4,136           |
| WELLTOWER INC                | 0.6              | 1.2            | 82             | 9,517           |
| HCP INC                      | 0.7              | 1.2            | 36             | 4,287           |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 0.3              | 0.3            | 12             | 1,396           |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | —                | 0.45           | 43             | 5,082           |
| MACERICH CO/THE              | 0.3              | 0.3            | 21             | 2,484           |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 1.5              | 3.7            | 37             | 4,384           |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | —                | 0.65           | 29             | 3,411           |
| REALTY INCOME CORP           | —                | 0.95           | 56             | 6,543           |
| PUBLIC STORAGE               | 0.25             | 0.45           | 102            | 11,834          |
| REGENCY CENTERS CORP         | 0.3              | 0.3            | 20             | 2,411           |
| SL GREEN REALTY CORP         | —                | 0.4            | 42             | 4,983           |
| UDR INC                      | —                | 1.2            | 43             | 5,016           |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 0.3              | 0.55           | 56             | 6,556           |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | —                | 0.5            | 39             | 4,537           |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 14.901<br>28銘柄 | 39.261<br>38銘柄 | 2,050<br><1.9%> |
| (オーストラリア)                    | 千口               | 千口             | 千オーストラリア・ドル    | 千円              |
| SCENTRE GROUP                | 12.629           | 22.429         | 105            | 8,958           |
| DEXUS PROPERTY GROUP         | —                | 2.5            | 23             | 2,024           |
| GPT GROUP                    | 6.82             | 6.82           | 34             | 2,932           |
| MIRVAC GROUP                 | 13.9             | 13.9           | 29             | 2,521           |
| STOCKLAND                    | 6.1              | 6.1            | 27             | 2,384           |
| WESTFIELD CORP               | 2.6              | 5.6            | 53             | 4,530           |
| GOODMAN GROUP                | 3.7              | 8.8            | 62             | 5,350           |
| VICINITY CENTRES             | 4.523            | 19.523         | 58             | 4,987           |
| オーストラリア・ドル<br>通貨計            | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 50.272<br>7銘柄  | 85.672<br>8銘柄  | 395<br><0.3%>   |

| 銘 柄                          |         | 期 首    |         | 期 末        |         |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|---------|
|                              |         | 口 数    | 口 数     | 評 価 額      | 評 価 額   |
| (香港)                         |         | 千口     | 千口      | 千香港ドル      | 千円      |
| LINK REIT                    |         | 3      | 9.5     | 499        | 7,470   |
| 香 港 ド ル 通 貨 計                | 口数、金額   | 3      | 9.5     | 499        | 7,470   |
|                              | 銘柄数<比率> | 1銘柄    | 1銘柄     |            | <0.1%>  |
| (シンガポール)                     |         | 千口     | 千口      | 千シンガポール・ドル | 千円      |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |         | —      | 12      | 28         | 2,307   |
| CAPITALAND MALL TRUST        |         | 9      | 9       | 17         | 1,428   |
| シンガポール・ドル 通 貨 計              | 口数、金額   | 9      | 21      | 46         | 3,736   |
|                              | 銘柄数<比率> | 1銘柄    | 2銘柄     |            | <0.0%>  |
| (イギリス)                       |         | 千口     | 千口      | 千イギリス・ポンド  | 千円      |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |         | 0.9    | 3.05    | 31         | 4,441   |
| SEGRO PLC                    |         | 1.52   | 1.52    | 7          | 1,005   |
| HAMMERSON PLC                |         | 1.2    | 1.2     | 6          | 957     |
| BRITISH LAND CO PLC          |         | 2.3    | 2.3     | 14         | 2,027   |
| イギリス・ポンド 通 貨 計               | 口数、金額   | 5.92   | 8.07    | 59         | 8,431   |
|                              | 銘柄数<比率> | 4銘柄    | 4銘柄     |            | <0.1%>  |
| ユーロ (フランス)                   |         | 千口     | 千口      | 千ユーロ       | 千円      |
| UNIBAIL – RODAMCO SE         |         | 0.15   | 0.37    | 82         | 10,173  |
| GECINA SA                    |         | —      | 0.14    | 17         | 2,207   |
| KLEPIERRE                    |         | 0.2    | 0.6     | 21         | 2,700   |
| ユーロ通貨計                       | 口数、金額   | 0.35   | 1.11    | 122        | 15,081  |
|                              | 銘柄数<比率> | 2銘柄    | 3銘柄     |            | <0.1%>  |
| 合 計                          | 口数、金額   | 83.443 | 164.613 | —          | 306,200 |
|                              | 銘柄数<比率> | 43銘柄   | 56銘柄    |            | <2.5%>  |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

| 銘 柄 別 |                             | 当 期 末      |          |
|-------|-----------------------------|------------|----------|
|       |                             | 買 建 額      | 売 建 額    |
| 外     | S&P500 (アメリカ)               | 百万円<br>459 | 百万円<br>— |
|       | S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ) | 65         | —        |
|       | FT 100 (イギリス)               | 70         | —        |
| 国     | EURO STOXX 50 (ドイツ)         | 93         | —        |

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年1月10日現在

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>11,208,630 | %<br>88.5 |
| 投資信託証券       | 306,200          | 2.4       |
| コール・ローン等、その他 | 1,154,152        | 9.1       |
| 投資信託財産総額     | 12,668,982       | 100.0     |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。  
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝115.96円、1カナダ・ドル＝87.72円、1オーストラリア・ドル＝85.16円、1香港ドル＝14.95円、1シンガポール・ドル＝80.79円、1ニュージーランド・ドル＝81.36円、1イギリス・ポンド＝140.83円、1イスラエル・シェケル＝30.16円、1スイス・フラン＝114.37円、1デンマーク・クローネ＝16.52円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝12.83円、1ユーロ＝122.78円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産 (11,988,881千円) の投資信託財産総額 (12,668,982千円) に対する比率は、94.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年1月10日現在

| 項 目            | 当 期 末           |
|----------------|-----------------|
| (A) 資産         | 24,539,159,531円 |
| コール・ローン等       | 772,646,523     |
| 株式(評価額)        | 11,208,630,134  |
| 投資信託証券(評価額)    | 306,200,468     |
| 未収入金           | 12,032,120,677  |
| 未収配当金          | 13,767,352      |
| 差入委託証拠金        | 205,794,377     |
| (B) 負債         | 12,237,297,155  |
| 未払金            | 12,237,297,155  |
| (C) 純資産総額(A－B) | 12,301,862,376  |
| 元本             | 7,765,887,299   |
| 次期繰越損益金        | 4,535,975,077   |
| (D) 受益権総口数     | 7,765,887,299口  |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 15,841円         |

\* 期首における元本額は3,950,340,521円、当期中における追加設定元本額は4,607,939,602円、同解約元本額は792,392,824円です。  
\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 4,451,587,527円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 880,692,967円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 2,433,606,805円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,841円です。

■損益の状況

当期 自2016年1月13日 至2017年1月10日

| 項 目                      | 当 期            |
|--------------------------|----------------|
| (A) 配当等収益                | 144,575,633円   |
| 受取配当金                    | 143,741,742    |
| 受取利息                     | 90,123         |
| その他収益金                   | 815,203        |
| 支払利息                     | △ 71,435       |
| (B) 有価証券売買損益             | 939,871,022    |
| 売買益                      | 2,765,576,221  |
| 売買損                      | △1,825,705,199 |
| (C) 先物取引等損益              | 97,647,286     |
| 取引益                      | 107,163,411    |
| 取引損                      | △ 9,516,125    |
| (D) その他費用                | △ 9,089,255    |
| (E) 当期損益金(A + B + C + D) | 1,173,004,686  |
| (F) 前期繰越損益金              | 1,366,965,369  |
| (G) 解約差損益金               | △ 366,270,176  |
| (H) 追加信託差損益金             | 2,362,275,198  |
| (I) 合計(E + F + G + H)    | 4,535,975,077  |
| 次期繰越損益金(I)               | 4,535,975,077  |

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

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

《お知らせ》

■投資信託証券への投資制限の変更

当ファンドにおいて、投資信託証券への投資比率の上限を純資産総額の5%としていますが、上場投資信託については、この制限の適用除外とし、5%を超えて投資できることとする変更を行ないました。