

インデックスファンド海外株式（ヘッジなし） <愛称 DC インデックス海外株式（ヘッジなし）>

運用報告書（全体版）

第16期（決算日 2017年10月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
 「インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）」は、2017年10月26日に第16期の決算を行ないましたので、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き立てを賜りますようお願い申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	2001年10月17日から原則無期限です。	
運用方針	主として「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券に投資を行ない、「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	インデックスファンド 海外株式（ヘッジなし）	「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI （ヘッジなし）マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	インデックスファンド 海外株式（ヘッジなし）	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI （ヘッジなし）マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	

<958387>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
<http://www.nikkoam.com/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
 午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額			
	(分配落)	税 分 配	込 み 金	期 騰 落	中 率					(ベンチマーク)	期 騰 落	率
	円		円		%			%	百万円			
12期(2013年10月28日)	15,580		10		52.1	138.28		49.4	96.7	1.1	2.1	9,886
13期(2014年10月27日)	18,289		10		17.5	160.02		15.7	95.5	2.2	2.3	10,422
14期(2015年10月26日)	21,151		10		15.7	182.55		14.1	95.0	2.5	2.5	10,189
15期(2016年10月26日)	18,375		10		△13.1	156.18		△14.4	95.5	1.9	2.7	8,458
16期(2017年10月26日)	24,203		10		31.8	203.07		30.0	96.4	1.0	2.5	10,020

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

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

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

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAIインデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2017年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2016年10月26日	18,375	—	156.18	—	95.5	1.9	2.7
10月末	18,373	△ 0.0	156.12	△ 0.0	95.3	2.1	2.6
11月末	20,064	9.2	170.23	9.0	94.7	2.7	2.5
12月末	21,316	16.0	180.61	15.6	95.7	1.6	2.6
2017年1月末	21,232	15.5	180.09	15.3	96.5	0.9	2.6
2月末	21,633	17.7	183.44	17.5	95.6	1.9	2.6
3月末	21,826	18.8	184.82	18.3	95.9	1.4	2.6
4月末	21,965	19.5	185.50	18.8	95.9	1.4	2.6
5月末	22,283	21.3	187.67	20.2	96.3	1.2	2.6
6月末	22,616	23.1	190.19	21.8	95.7	1.7	2.6
7月末	22,771	23.9	191.54	22.6	96.3	1.2	2.6
8月末	22,668	23.4	190.40	21.9	96.0	1.3	2.6
9月末	23,710	29.0	198.90	27.4	95.5	2.0	2.5
(期 末)							
2017年10月26日	24,213	31.8	203.07	30.0	96.4	1.0	2.5

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

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

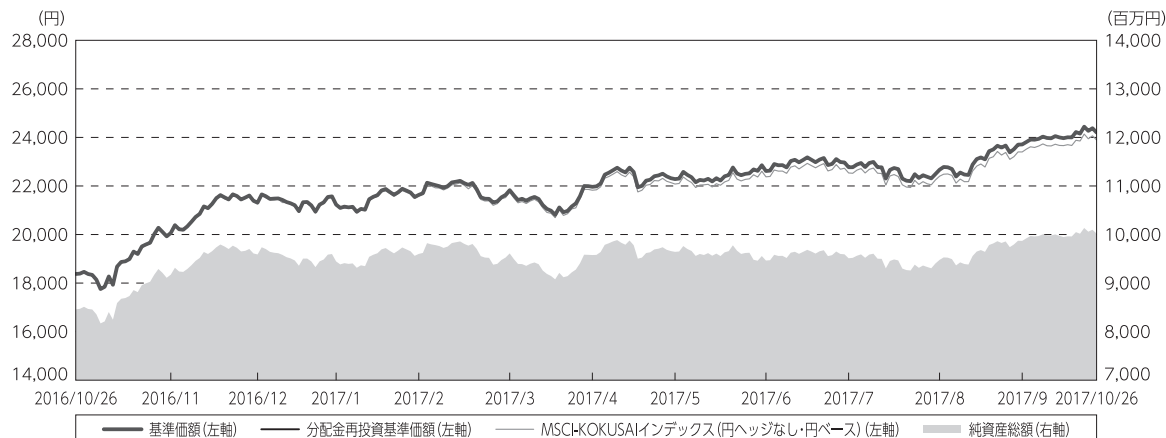
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2016年10月27日～2017年10月26日)

期中の基準価額等の推移



期首：18,375円

期末：24,203円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：31.8%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびMSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）は、期首（2016年10月26日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）は当ファンドのベンチマークです。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主に、「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・米国大統領選挙後に新政権の減税や財政支出拡大による景気刺激策が経済成長を加速させるとの期待が高まったこと。
- ・フランス大統領選挙の結果を受けて欧州連合（EU）の混乱が回避されるとの期待が高まったこと。
- ・円安／アメリカドル高、円安／ユーロ高、円安／イギリスポンド高が進行したこと。

＜値下がり要因＞

- ・米国政権とロシアとの不透明な関係を巡り米国の政治運営の停滞が懸念されたこと。
- ・ユーロがアメリカドルに対して上昇したため、ユーロ圏輸出企業の利益を圧迫するとの懸念が強まったこと。
- ・北朝鮮情勢が緊迫化したこと。

投資環境

（海外株式市況）

海外株式市場では、期間の初めと比べて、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

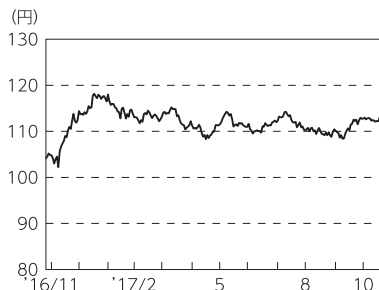
期間の初めから2016年12月下旬にかけては、米国大統領選挙後に新政権の減税や財政支出拡大による景気刺激策が経済成長を加速させるとの期待が強まったことや、石油輸出国機構（OPEC）と非加盟国が減産で合意し原油価格の安定が期待されたこと、欧州中央銀行（ECB）による景気支援策が好感されたことなどを背景に、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。2017年1月上旬から4月中旬にかけては、米国政権の法人税改革に対する期待が高まったことや、米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が景気に楽観的な見方を示したこと、フランス大統領選挙の第一回投票の結果を受けてEUの混乱が回避されるとの期待が高まり、市場参加者の間に安心感が戻ったことなどを背景に、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。4月下旬から6月下旬にかけては、米国政権とロシアとの不透明な関係を巡り米国の政治運営の停滞が懸念され、リスク回避の動きから株価が大きく下げる局面があったものの、フランス大統領選挙における独立系中道候補の勝利に対する期待の高まりや、市場予想を上回る決算発表を受けて欧州企業の業績回復に対する楽観的な見方が強まったことなどから、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

7月上旬から期間末にかけては、ユーロがアメリカドルに対して上昇したため、ユーロ圏輸出企業の利益を圧迫するとの懸念や、北朝鮮情勢が緊迫化したことを受けて、株価が下落する局面があったものの、ECBが2017年のユーロ圏成長率見通しを上方修正したことや、米国政権が大規模な税制改革案を公表し、減税で景気が加速するとの見方を背景に米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

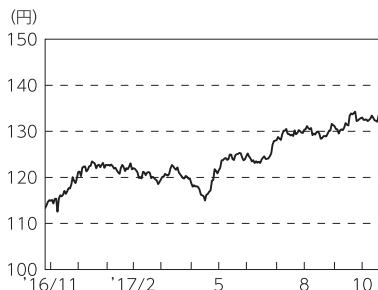
（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。

円／アメリカドルの推移



円／ユーロの推移



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券を高位に組み入れて運用を行ないました。

（海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド）

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、31.8%（分配金込み）の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率30.0%を1.7%上回ることとなりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

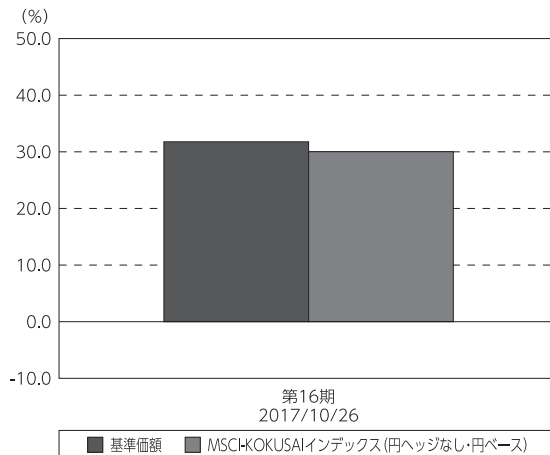
＜プラス要因＞

- ・現物株式の組入れに基づく要因が寄与したこと。
- ・株式配当金を受け取ったこと。

＜マイナス要因＞

- ・海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

（注）MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）は当ファンドのベンチマークです。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第16期
	2016年10月27日～ 2017年10月26日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.041%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	18,158

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

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、ファンドの基本方針に則り、「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行ないます。

（海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド）

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年10月27日～2017年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	197	0.907	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(68)	(0.313)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(113)	(0.518)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(16)	(0.076)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.006	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(1)	(0.005)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、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)	
(d) そ の 他 費 用	7	0.031	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(5)	(0.024)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.005)	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)	(0.001)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	205	0.946	
期中の平均基準価額は、21,704円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2016年10月27日～2017年10月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	千口 112,491	千円 237,859	千口 630,586	千円 1,337,336

○株式売買比率

(2016年10月27日～2017年10月26日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	8,744,919千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	73,854,518千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

○利害関係人との取引状況等

(2016年10月27日～2017年10月26日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2016年10月27日～2017年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2016年10月27日～2017年10月26日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2017年10月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	4,750,975	4,232,881	10,019,229

(注) 親投資信託の2017年10月26日現在の受益権総口数は、34,878,791千口です。

○投資信託財産の構成

(2017年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	10,019,229	99.3
コール・ローン等、その他	66,695	0.7
投資信託財産総額	10,085,924	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（82,355,272千円）の投資信託財産総額（82,748,089千円）に対する比率は99.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=113.57円、1カナダドル=88.74円、1ユーロ=134.19円、1イギリスポンド=150.64円、1スイスフラン=114.76円、1スウェーデンクローナ=13.83円、1ノルウェークローネ=14.17円、1デンマーククローネ=18.03円、1オーストラリアドル=87.46円、1ニュージーランドドル=78.10円、1香港ドル=14.55円、1シンガポールドル=83.51円、1イスラエルシェケル=32.37円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年10月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,085,924,844
コール・ローン等	51,947,708
新設式インデックスNCSJ-100151（ヘッジなし）マザーファンド(信託)	10,019,229,371
未収入金	14,747,765
(B) 負債	65,686,656
未払収益分配金	4,140,071
未払解約金	17,392,306
未払信託報酬	43,898,197
未払利息	68
その他未払費用	256,014
(C) 純資産総額(A－B)	10,020,238,188
元本	4,140,071,246
次期繰越損益金	5,880,166,942
(D) 受益権総口数	4,140,071,246口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,203円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,603,060,394円、期中追加設定元本額は417,202,537円、期中一部解約元本額は880,191,685円です。

(注) 1口当たり純資産額は2,4203円です。

○損益の状況（2016年10月27日～2017年10月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 10,865
受取利息	9
支払利息	△ 10,874
(B) 有価証券売買損益	2,368,253,359
売買益	2,654,987,492
売買損	△ 286,734,133
(C) 信託報酬等	△ 86,834,929
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	2,281,407,565
(E) 前期繰越損益金	1,958,961,324
(F) 追加信託差損益金	1,643,938,124
(配当等相当額)	(3,281,084,302)
(売買損益相当額)	(△1,637,146,178)
(G) 計(D+E+F)	5,884,307,013
(H) 収益分配金	△ 4,140,071
次期繰越損益金(G+H)	5,880,166,942
追加信託差損益金	1,643,938,124
(配当等相当額)	(3,281,680,319)
(売買損益相当額)	(△1,637,742,195)
分配準備積立金	4,236,228,818

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注) 分配金の計算過程（2016年10月27日～2017年10月26日）は以下の通りです。

項 目	2016年10月27日～ 2017年10月26日
a. 配当等収益(経費控除後)	194,279,565円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	1,023,242,229円
c. 信託約款に定める収益調整金	3,281,680,319円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	3,022,847,095円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	7,522,049,208円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	18,168円
g. 分配金	4,140,071円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

○お知らせ

約款変更について

2016年10月27日から2017年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、直販による取扱いを可能とするため、2017年1月20日付けにて信託約款に所要の変更を行いました。（第11条、第43条、第43条の2、第46条、第48条、附則第2条）
- 当ファンドについて、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2に定める信用リスクを適正に管理する方法として、一般社団法人投資信託協会規則に従って委託会社が合理的な方法を定めるべく、2017年1月20日付けにて信託約款に所要の変更を行いました。（付表）

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2017年10月26日）
（2016年10月27日～2017年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2000年5月17日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引など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。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<935026>

【運用報告書の表記について】

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資 産額
	騰落	率	(ベンチマーク) 騰落	率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2013年10月28日)	14,674	53.4	111.00	49.4	96.7	1.1	2.1	77,949
15期(2014年10月27日)	17,388	18.5	128.45	15.7	95.5	2.2	2.3	78,486
16期(2015年10月26日)	20,298	16.7	146.54	14.1	95.0	2.5	2.5	79,510
17期(2016年10月26日)	17,803	△12.3	125.37	△14.4	95.5	1.9	2.7	69,214
18期(2017年10月26日)	23,670	33.0	163.01	30.0	96.4	1.0	2.5	82,557

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAIインデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2017年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率
	騰落	率	(ベンチマーク) 騰落	率			
(期首) 2016年10月26日	円	%		%	%	%	%
	17,803	—	125.37	—	95.5	1.9	2.7
10月末	17,803	0.0	125.33	△0.0	95.3	2.1	2.6
11月末	19,456	9.3	136.65	9.0	94.7	2.7	2.5
12月末	20,685	16.2	144.98	15.6	95.7	1.6	2.6
2017年1月末	20,620	15.8	144.56	15.3	96.5	0.9	2.6
2月末	21,024	18.1	147.25	17.5	95.6	1.9	2.6
3月末	21,227	19.2	148.36	18.3	95.9	1.4	2.6
4月末	21,377	20.1	148.91	18.8	95.9	1.4	2.6
5月末	21,704	21.9	150.64	20.2	96.3	1.2	2.6
6月末	22,045	23.8	152.67	21.8	95.7	1.7	2.6
7月末	22,213	24.8	153.76	22.6	96.3	1.2	2.6
8月末	22,129	24.3	152.84	21.9	96.0	1.3	2.6
9月末	23,163	30.1	159.66	27.4	95.5	2.0	2.5
(期末) 2017年10月26日	円	%		%	%	%	%
	23,670	33.0	163.01	30.0	96.4	1.0	2.5

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○運用経過

(2016年10月27日～2017年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め17,803円の基準価額は、期間末に23,670円となり、騰落率は+33.0%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

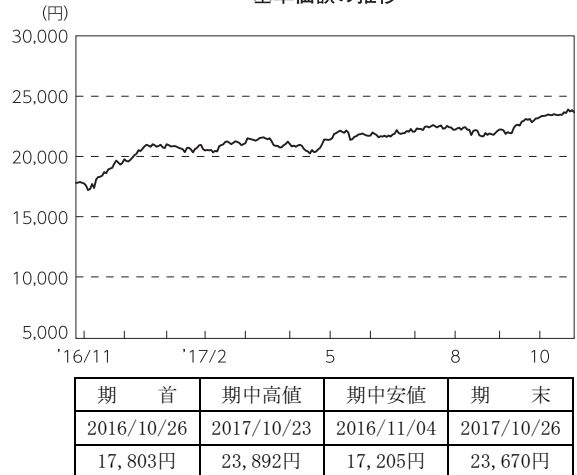
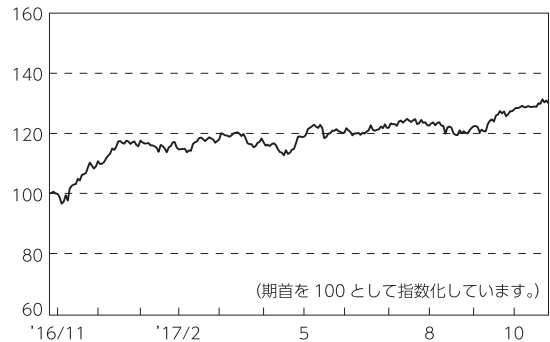
<値上がり要因>

- ・米国大統領選挙後に新政権の減税や財政支出拡大による景気刺激策が経済成長を加速させるとの期待が強まったこと。
- ・フランス大統領選挙の結果を受けて欧州連合（EU）の混乱が回避されるとの期待が高まったこと。
- ・円安/アメリカドル高、円安/ユーロ高、円安/イギリスポンド高が進行したこと。

<値下がり要因>

- ・米国政権とロシアとの不透明な関係を巡り米国の政治運営の停滞が懸念されたこと。
- ・ユーロがアメリカドルに対して上昇したため、ユーロ圏輸出企業の利益を圧迫するとの懸念が強まったこと。
- ・北朝鮮情勢が緊迫化したこと。

基準価額の推移

MSCI-KOKUSAIインデックス
(円ヘッジなし・円ベース) (指数化) の推移

（海外株式市況）

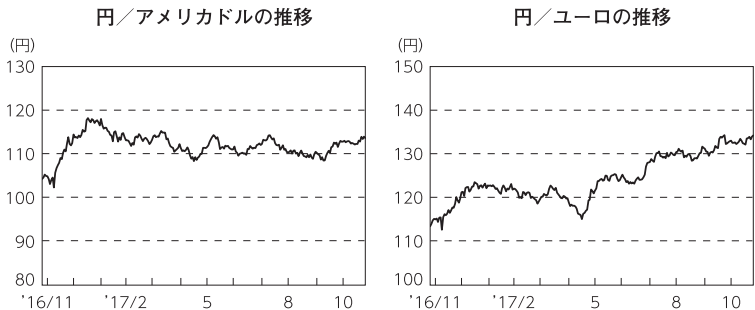
海外株式市場では、期間の初めと比べて、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

期間の初めから2016年12月下旬にかけては、米国大統領選挙後に新政権の減税や財政支出拡大による景気刺激策が経済成長を加速させるとの期待が強まったことや、石油輸出国機構（OPEC）と非加盟国が減産で合意し原油価格の安定が期待されたこと、欧州中央銀行（ECB）による景気支援策が好感されたことなどを背景に、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。2017年1月上旬から4月中旬にかけては、米政権の法人税改革に対する期待が高まったことや、米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が景気に楽観的な見方を示したこと、フランス大統領選挙の第一回投票の結果を受けてEUの混乱が回避されるとの期待が高まり、市場参加者の間に安心感が戻ったことなどを背景に、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。4月下旬から6月下旬にかけては、米政権とロシアとの不透明な関係を巡り米国の政治運営の停滞が懸念され、リスク回避の動きから株価が大きく下げる局面があったものの、フランス大統領選挙における独立系中道候補の勝利に対する期待の高まりや、市場予想を上回る決算発表を受けて欧州企業の業績回復に対する楽観的な見方が強まったことなどから、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

7月上旬から期間末にかけては、ユーロがアメリカドルに対して上昇したため、ユーロ圏輸出企業の利益を圧迫するとの懸念や、北朝鮮情勢が緊迫化したことを受けて、株価が下落する局面があったものの、ECBが2017年のユーロ圏成長率見通しを上方修正したことや、米政権が大規模な税制改革案を公表し、減税で景気が加速するとの見方を背景に米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、33.0%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率30.0%を概ね2.9%上回ることとなりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・現物株式の組入れに基づく要因が寄与したこと。
- ・株式配当金を受け取ったこと。

<マイナス要因>

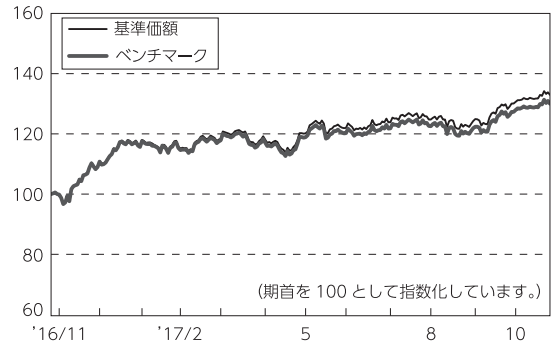
- ・海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年10月27日～2017年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1 (1) (0) (0)	0.006 (0.005) (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	0 (0) (0)	0.002 (0.002) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	5 (5) (0)	0.026 (0.025) (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	6	0.034	
期中の平均基準価額は、21,120円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年10月27日～2017年10月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 1,542 (1,540)	千アメリカドル 8,619 (3,931)	百株 7,820 (790)	千アメリカドル 44,221 (6,038)
	カナダ	97 (174)	千カナダドル 559 (811)	563 (-)	千カナダドル 2,278 (2)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	198 (379)	407 (194)	652 (51)	1,688 (251)
	イタリア	705 (△ 1,601)	217 (381)	1,436 (110)	499 (235)
	フランス	110 (44)	488 (△ 173)	423 (-)	1,884 (3)
	オランダ	32 (22)	117 (84)	272 (-)	569 (0.46)
	スペイン	473 (11,734)	478 (145)	4,259 (6,163)	593 (260)
	ベルギー	- (42)	- (59)	43 (21)	306 (59)
	オーストリア	- (14)	- (△ 3)	19 (291)	29 (-)
	ルクセンブルク	2 (△ 259)	91 (-)	13	41
	フィンランド	-	-	123	222
	アイルランド	- (△ 5,399)	- (-)	21	80
	イギリス	- (49)	- (149)	- (49)	- (149)
	イギリス	2,222 (27,549)	千イギリスポンド 1,080 (107)	4,759 (47,500)	千イギリスポンド 2,893 (123)
	スイス	70 (485)	千スイスフラン 291 (113)	350 (405)	千スイスフラン 3,485 (132)
	スウェーデン	7 (266)	千スウェーデンクローナ 409 (2,647)	362 (121)	千スウェーデンクローナ 5,304 (2,676)
	ノルウェー	- (-)	千ノルウェークローネ - (△ 87)	135	千ノルウェークローネ 1,333

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 54	千デンマーククローネ 1,458	百株 64	千デンマーククローネ 2,144
	オーストラリア	98 (90)	千オーストラリアドル 113 (5)	1,387 (624)	千オーストラリアドル 1,725 (130)
	ニュージーランド	135	千ニュージーランドドル 40	190	千ニュージーランドドル 98
	香港	170 (694)	千香港ドル 487 (6)	1,656 (164)	千香港ドル 4,548 (6)
	シンガポール	130	千シンガポールドル 64	967	千シンガポールドル 371
	イスラエル	42	千イスラエルシェケル 541	385	千イスラエルシェケル 3,639

(注) 金額は受け渡し代金。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
PROLOGIS INC	—	—	470	23
AMERICAN TOWER CORP	—	—	680	85
VEREIT INC	—	—	4,680	38
AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	—	230	36
BOSTON PROPERTIES INC	—	—	270	36
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	—	1,700	40
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	10,000	144	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	950	95	370	32
DIGITAL REALTY TRUST INC	900	107	—	—
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	—	—	450	27
EQUINIX INC	150	68	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	—	350	27
HCP INC	—	—	840	23
WELLTOWER INC	—	—	300	19
HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	1,420	26
JBG SMITH PROPERTIES	—	—	1,745	60
JBG SMITH PROPERTIES(N)	—	—	—	—
	(1,745)	(63)	—	—
MACERICH CO/THE	—	—	410	27
MID-AMERICA APARTMENT COMM	770	70	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	127	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	—	—	2,226	66
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI(N)	—	—	—	—
	(2,226)	(54)	—	—
PUBLIC STORAGE	—	—	170	36
QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	2,025	24
QUALITY CARE PROPERTIES(N)	—	—	—	—
	(2,025)	(—)	—	—
REGENCY CENTERS CORP	820	55	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	—	—	—
	(2,580)	(297)	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	—	—	440	75
SL GREEN REALTY CORP	—	—	220	24
VORNADO REALTY TRUST	—	—	320	30
	—	—	(—)	(63)
WEYERHAEUSER CO	—	—	990	31
小計	16,580	669	20,306	795
	(8,576)	(414)	(—)	(63)
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
FONCIERE DES REGIONS	—	—	—	—
	(—)	(△0.612)	—	—
GECINA SA-RTS	—	—	—	—
	—	—	(970)	(2)
GECINA SA-RTS(N)	—	—	—	—
	(970)	(—)	—	—
小計	—	—	—	—
	(970)	(△0.612)	(970)	(2)
ユーロ計	—	—	—	—
	(970)	(△0.612)	(970)	(2)

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	イギリス	口	千イギリスポンド	口	千イギリスポンド
	LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	(1,015)	(9)
	SEGRO PLC-NIL PAID RIGHTS-RTS	—	—	—	—
	SEGRO PLC	(3,010)	(3)	(3,010)	(3)
	SEGRO PLC(N)	—	—	(—)	(3)
	小計	(3,010)	(13)	—	—
	オーストラリア	—	—	—	—
	APA GROUP	—	—	5,120	38
	GPT GROUP	—	—	11,190	51
	小計	—	—	16,310	90
国	シンガポール	—	—	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	—	—	—	—
	CAPITACOMMERCIAL TRUST (N)	(—)	(△0.277)	—	—
	CAPITALAND MALL TRUST	(6,640)	(10)	—	—
	CAPITALAND COMMERCIAL-RIGHTS-RTS	—	—	18,200	34
	CAPITALAND COMMERCIAL-RIGHTS-RTS (N)	—	—	(6,640)	(1)
	SUNTEC REIT	(6,640)	(—)	—	—
	小計	(—)	(△0.401)	—	—
小計	(13,280)	(10)	18,200 (6,640)	34 (1)	

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

リミテッドパートナー(出資金)

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
		(△3,373)	(△2)	—	—

(注) 金額は受け渡し代金。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 11,467	百万円 12,293	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受け渡し代金。

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

○株式売買比率

(2016年10月27日～2017年10月26日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	8,744,919千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	73,854,518千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

○利害関係人との取引状況等

(2016年10月27日～2017年10月26日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2016年10月27日～2017年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2017年10月26日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
3M CO	132	121	2,889	328,130	資本財
ABBVIE INC	354	324	2,975	337,954	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	318	353	1,964	223,065	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	138	126	1,789	203,247	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	102	95	1,471	167,113	保険
ACUITY BRANDS INC	9	9	150	17,050	資本財
ADVANCE AUTO PARTS INC	16	15	125	14,267	小売
AES CORP	137	137	149	16,994	公益事業
AETNA INC	76	68	1,091	124,002	ヘルスケア機器・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	34	26	138	15,727	資本財
AFLAC INC	90	78	657	74,683	保険
AFFILIATED MANAGERS GROUP	12	11	208	23,634	各種金融
AGCO CORP	16	12	88	9,998	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	70	66	446	50,666	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	45	42	657	74,704	素材
ALLEGHANY CORP	3	3	186	21,200	保険
ALLSTATE CORP	81	77	724	82,239	保険
ALTRIA GROUP INC	429	391	2,498	283,757	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	106	—	—	—	資本財
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	12	10	253	28,790	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	52	42	183	20,875	公益事業
ALBEMARLE CORP	25	23	321	36,500	素材
ALLEGION PLC	—	17	151	17,189	資本財
ALLY FINANCIAL INC	91	91	234	26,587	各種金融
AMPHENOL CORP-CL A	64	64	562	63,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36	30	480	54,582	各種金融
AMEREN CORPORATION	51	46	281	31,933	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	248	189	1,230	139,772	保険
AMERICAN EXPRESS CO	179	154	1,444	164,049	各種金融
AMETEK INC	50	45	310	35,269	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	106	97	720	81,876	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40	34	300	34,109	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	40	32	267	30,384	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	14	156	17,722	保険
ANADARKO PETROLEUM CORP	121	112	534	60,664	エネルギー
ANTERO RESOURCES CORP	36	36	67	7,715	エネルギー
AON PLC	57	53	812	92,263	保険
APACHE CORP	82	79	312	35,466	エネルギー
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	130	113	492	55,960	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	23	19	160	18,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	33	33	206	23,438	保険
ARAMARK	49	49	213	24,205	消費者サービス
ARCONIC INC	—	79	197	22,416	資本財
ARISTA NETWORKS INC	—	8	159	18,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	15	12	126	14,394	保険
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	16	—	—	—	素材
AT&T INC	1,349	1,252	4,193	476,295	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	23	19	165	18,761	公益事業
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	—	22	120	13,702	保険
AUTOLIV INC	20	17	216	24,602	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	6	5	324	36,824	小売

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
AUTONATION INC	16	16	77	8,747	小売	
AVERY DENNISON CORP	22	18	189	21,506	素材	
AVNET INC	34	26	104	11,883	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	21	14	83	9,501	保険	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	41	41	121	13,762	素材	
BALL CORP	36	68	290	32,975	素材	
BANK OF AMERICA CORP	2,243	2,020	5,582	633,986	銀行	
BAXTER INTERNATIONAL INC	109	103	669	76,033	ヘルスケア機器・サービス	
BAKER HUGHES A GE CO LLC	96	—	—	—	エネルギー	
CR BARD INC	15	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	235	208	1,081	122,787	各種金融	
BAKER HUGHES A GE CO	—	81	243	27,678	エネルギー	
BB&T CORP	175	158	756	85,942	銀行	
BECTON DICKINSON AND CO	46	52	1,106	125,610	ヘルスケア機器・サービス	
BEST BUY CO INC	65	55	306	34,862	小売	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	262	253	4,778	542,653	各種金融	
BLACKROCK INC	26	24	1,161	131,871	各種金融	
H&R BLOCK INC	56	45	116	13,286	消費者サービス	
BORGWARNER INC	43	43	223	25,404	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	287	287	850	96,640	ヘルスケア機器・サービス	
BOEING CO/THE	131	116	3,021	343,145	資本財	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	364	334	2,138	242,919	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	24	24	203	23,157	ソフトウェア・サービス	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50	42	235	26,701	食品・飲料・タバコ	
BUNGE LTD	31	28	200	22,719	食品・飲料・タバコ	
CARMAX INC	42	39	294	33,432	小売	
CARDINAL HEALTH INC	71	65	440	49,991	ヘルスケア機器・サービス	
CATERPILLAR INC	126	119	1,634	185,651	資本財	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	116	97	889	101,029	各種金融	
CARNIVAL CORP	79	72	477	54,263	消費者サービス	
CALPINE CORP	80	—	—	—	公益事業	
CABOT OIL & GAS CORP	114	97	237	26,984	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	42	34	161	18,289	食品・飲料・タバコ	
CBRE GROUP INC	66	59	232	26,353	不動産	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	94	74	426	48,474	メディア	
CENTENE CORP	37	35	320	36,385	ヘルスケア機器・サービス	
CELANESE CORP-SERIES A	32	29	312	35,471	素材	
CENTERPOINT ENERGY INC	81	81	239	27,167	公益事業	
CENTURYLINK INC	126	196	363	41,301	電気通信サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	48	48	182	20,754	素材	
CHURCH & DWIGHT CO INC	59	54	248	28,219	家庭用品・パーソナル用品	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	4	134	15,258	消費者サービス	
CHEVRON CORP	412	384	4,555	517,347	エネルギー	
CIT GROUP INC	45	26	123	14,021	銀行	
CIGNA CORP	55	52	1,021	116,017	ヘルスケア機器・サービス	
CITIGROUP INC	641	558	4,115	467,356	銀行	
CIMAREX ENERGY CO	20	20	226	25,740	エネルギー	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	112	105	402	45,738	銀行	
CLOROX COMPANY	27	27	347	39,490	家庭用品・パーソナル用品	
CMS ENERGY CORP	61	53	256	29,146	公益事業	
CONCHO RESOURCES INC	30	30	398	45,288	エネルギー	
COLGATE-PALMOLIVE CO	186	171	1,224	139,025	家庭用品・パーソナル用品	
CONOCOPHILLIPS	269	252	1,260	143,210	エネルギー	
COACH INC	62	56	229	26,043	耐久消費財・アパレル	
COMERICA INC	33	33	265	30,100	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	89	89	304	34,526	食品・飲料・タバコ	
COCA-COLA CO/THE	902	825	3,799	431,529	食品・飲料・タバコ	
CONSOLIDATED EDISON INC	63	63	538	61,110	公益事業	

銘柄	株数	期首(前期末) 当期 期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
CONSTELLATION BRANDS INC-A	37	34	735	83,494	食品・飲料・タバコ	
CORNING INC	243	183	579	65,865	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	19	19	73	8,400	エネルギー	
CORE LABORATORIES N.V.	10	7	74	8,452	エネルギー	
COTY INC-CL A	100	100	152	17,319	家庭用品・パーソナル用品	
CROWN HOLDINGS INC	28	28	167	19,015	素材	
CSX CORP	209	187	990	112,527	運輸	
CUMMINS INC	36	31	565	64,196	資本財	
CVS HEALTH CORP	239	207	1,563	177,623	食品・生活必需品小売り	
DAVITA INC	39	34	215	24,442	ヘルスケア機器・サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	29	25	208	23,720	消費者サービス	
DANAHER CORP	134	127	1,152	130,943	ヘルスケア機器・サービス	
DEVON ENERGY CORPORATION	110	99	343	38,976	エネルギー	
DEERE & CO	57	57	745	84,666	資本財	
DELTA AIR LINES INC	42	39	206	23,464	運輸	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	60	54	527	59,954	自動車・自動車部品	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	47	43	356	40,525	ソフトウェア・サービス	
DICK'S SPORTING GOODS INC	21	17	46	5,308	小売	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	93	76	497	56,529	各種金融	
DOMINO'S PIZZA INC	10	10	189	21,517	消費者サービス	
DOMINION RESOURCES INC/VA	134	126	1,006	114,264	公益事業	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	62	54	457	51,973	小売	
DOVER CORP	36	31	299	33,985	資本財	
DOW CHEMICAL CO/THE	246	—	—	—	素材	
DOWDUPONT INC	—	474	3,370	382,830	素材	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41	37	322	36,606	食品・飲料・タバコ	
DR HORTON INC	79	79	343	38,989	耐久消費財・アパレル	
DTE ENERGY COMPANY	36	36	409	46,521	公益事業	
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	191	—	—	—	素材	
DUKE ENERGY CORP	150	142	1,250	142,071	公益事業	
DUN & BRADSTREET CORP	8	—	—	—	商業・専門サービス	
DXC TECHNOLOGY CO	—	59	534	60,758	ソフトウェア・サービス	
EATON VANCE CORP	28	22	114	13,023	各種金融	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	33	30	273	31,032	素材	
EATON CORP PLC	97	90	712	80,961	資本財	
ECOLAB INC	56	54	720	81,855	素材	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	46	44	455	51,752	ヘルスケア機器・サービス	
EDISON INTERNATIONAL	70	65	520	59,124	公益事業	
EMERSON ELECTRIC CO	138	129	862	97,954	資本財	
ENTERGY CORP	38	38	332	37,722	公益事業	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	13	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	36	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	23	98	11,183	ヘルスケア機器・サービス	
EOG RESOURCES INC	120	118	1,134	128,874	エネルギー	
EQUIFAX INC	26	24	258	29,360	商業・専門サービス	
EQT CORP	38	34	209	23,811	エネルギー	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	47	44	497	56,537	家庭用品・パーソナル用品	
EVEREST RE GROUP LTD	10	8	203	23,121	保険	
EXXON MOBIL CORP	908	861	7,163	813,560	エネルギー	
EXELON CORP	196	190	761	86,491	公益事業	
FEDEX CORP	57	51	1,160	131,840	運輸	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	30	30	305	34,716	銀行	
FIRSTENERGY CORP	89	89	286	32,536	公益事業	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	69	64	616	70,032	ソフトウェア・サービス	
FIRST DATA CORP- CLASS-A	—	61	115	13,074	ソフトウェア・サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	21	19	320	36,408	ソフトウェア・サービス	
FLOWSERVE CORP	29	25	114	12,993	資本財	
FLUOR CORP	32	29	123	14,011	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TECHNIPFMC PLC	44	93	235	26,719	エネルギー
FMC CORP	32	27	260	29,534	素材
FNF GROUP	58	52	185	21,041	保険
FORD MOTOR COMPANY	809	762	917	104,242	自動車・自動車部品
FOOT LOCKER INC	31	28	88	10,021	小売
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	31	31	211	24,001	資本財
FORTIVE CORP	67	63	461	52,378	資本財
NEXTERA ENERGY INC	100	95	1,471	167,137	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	79	66	292	33,268	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	257	257	378	42,985	素材
GAP INC/THE	51	51	138	15,720	小売
TEGNA INC	43	—	—	—	メディア
GENERAL MOTORS CORP	302	275	1,244	141,301	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	32	28	251	28,541	小売
GENERAL ELECTRIC CO	2,015	1,762	3,789	430,415	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	57	51	1,073	121,970	資本財
GENERAL MILLS INC	125	114	589	66,944	食品・飲料・タバコ
GLOBAL PAYMENTS INC	32	32	318	36,167	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	82	72	1,747	198,415	各種金融
WW GRAINGER INC	13	10	208	23,664	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	83	69	380	43,236	保険
HALLIBURTON CO	186	180	747	84,882	エネルギー
HANESBRANDS INC	88	79	180	20,541	耐久消費財・アパレル
HARMAN INTERNATIONAL	16	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP	28	25	348	39,548	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARLEY-DAVIDSON INC	40	37	181	20,593	自動車・自動車部品
HCA HEALTHCARE INC	69	64	508	57,791	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	33	30	327	37,186	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	60	60	253	28,762	エネルギー
HELMERICH & PAYNE	21	21	108	12,353	エネルギー
HP INC	386	340	736	83,688	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	386	329	463	52,633	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	111	37	264	30,050	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	159	147	2,152	244,489	資本財
HOME DEPOT INC	274	243	4,038	458,689	小売
HORMEL FOODS CORP	66	59	180	20,522	食品・飲料・タバコ
HOLLYFRONTIER CORP	37	37	135	15,418	エネルギー
HUMANA INC	32	29	731	83,067	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	9	224	25,512	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	200	182	2,794	317,315	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	—	14	180	20,487	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	69	63	995	113,076	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16	16	248	28,195	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	87	68	133	15,161	メディア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	26	119	790	89,749	各種金融
INVESCO LTD	93	84	311	35,425	各種金融
INTERNATIONAL PAPER CO	86	81	470	53,477	素材
INGERSOLL-RAND PLC	58	53	487	55,340	資本財
INGREDION INC	14	14	183	20,813	食品・飲料・タバコ
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	28	24	140	15,962	資本財
JM SMUCKER CO/THE	25	22	233	26,557	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	602	548	7,807	886,659	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	8	8	112	12,723	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	801	721	7,289	827,880	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	76	70	172	19,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	23	21	220	25,070	運輸
KEYCORP	226	226	415	47,183	銀行
KELLOGG CO	57	54	327	37,146	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
KIMBERLY-CLARK CORP	78	72	819	93,097	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	415	407	730	83,016	エネルギー
KOHL'S CORP	44	38	169	19,256	小売
KROGER CO	196	190	402	45,714	食品・生活必需品小売り
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	17	—	—	—	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	—	16	311	35,335	資本財
LAS VEGAS SANDS CORP	94	81	514	58,443	消費者サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	21	21	329	37,374	ヘルスケア機器・サービス
LEGGETT & PLATT INC	33	27	133	15,112	耐久消費財・アパレル
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	65	—	—	—	電気通信サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	73	73	185	21,105	各種金融
LENNAR CORP-CL A	43	39	225	25,662	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	7	135	15,360	資本財
LEAR CORP	15	13	234	26,686	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	217	201	1,708	194,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	53	45	345	39,188	保険
L BRANDS INC	53	53	235	26,699	小売
LINKEDIN CORP - A	25	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	57	53	1,665	189,158	資本財
LOWE'S COS INC	197	172	1,396	158,592	小売
LOEWS CORP	64	61	294	33,453	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	81	67	673	76,468	素材
M & T BANK CORP	30	28	466	52,968	銀行
MARATHON OIL CORP	178	178	240	27,353	エネルギー
MASTERCARD INC	213	193	2,835	322,038	ソフトウェア・サービス
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	15	108	12,361	運輸
MACY'S INC	70	64	137	15,604	小売
MANPOWERGROUP INC	19	14	178	20,252	商業・専門サービス
MARSH & MCLENNAN COS	113	108	914	103,827	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13	12	264	30,008	素材
MASCO CORP	75	67	269	30,586	資本財
MARKEL CORP	3	2	298	33,955	保険
MARATHON PETROLEUM CORP	114	108	612	69,560	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	24	24	75	8,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	22	22	224	25,545	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	191	166	2,730	310,081	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	58	54	875	99,456	各種金融
MCKESSON CORP	49	43	654	74,339	ヘルスケア機器・サービス
MEDNAX INC	22	18	81	9,216	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	200	185	999	113,544	保険
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	39	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MERCK & CO. INC.	606	556	3,474	394,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	306	279	2,216	251,744	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	5	359	40,809	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM RESORTS INTERNATIONAL	97	97	302	34,328	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	40	35	175	19,936	耐久消費財・アパレル
MICRON TECHNOLOGY INC	232	218	898	102,063	半導体・半導体製造装置
MOLSON COORS BREWING CO -B	40	38	318	36,154	食品・飲料・タバコ
MOHAWK INDUSTRIES INC	14	13	346	39,389	耐久消費財・アパレル
MOSAIC CO/THE	74	68	146	16,683	素材
MORGAN STANLEY	317	283	1,431	162,548	各種金融
MONSANTO CO	95	88	1,079	122,597	素材
MOODY'S CORP	39	36	529	60,132	各種金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33	36	329	37,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	35	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MSCI INC	20	20	237	26,925	各種金融
MURPHY OIL CORP	37	37	92	10,556	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	82	75	252	28,725	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NETSUITE INC	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	40	40	116	13,223	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	112	105	388	44,074	素材
NEWELL BRANDS INC	99	91	368	41,839	耐久消費財・アパレル
NIKE INC -CL B	294	268	1,476	167,643	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	65	65	173	19,712	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	78	74	285	32,428	商業・専門サービス
NORDSTROM INC	28	28	118	13,438	小売
NORTHROP GRUMMAN CORP	38	33	1,031	117,121	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	65	58	754	85,645	運輸
NOBLE ENERGY INC	94	94	253	28,825	エネルギー
EVERSOURCE ENERGY	69	63	392	44,596	公益事業
NRG ENERGY INC	76	—	—	—	公益事業
NUCOR CORP	71	65	387	44,008	素材
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	96	96	120	13,705	銀行
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	167	158	1,032	117,271	エネルギー
OGE ENERGY CORP	46	38	140	15,976	公益事業
OMNICOM GROUP	54	45	319	36,287	メディア
ONEOK INC	45	76	413	46,907	エネルギー
ORACLE CORP	686	630	3,132	355,785	ソフトウェア・サービス
P G & E CORP	105	101	577	65,600	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	30	27	506	57,575	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	19	19	230	26,167	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	—	19	282	32,054	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	19	44	107	12,172	エネルギー
PEPSICO INC	317	290	3,198	363,281	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	40	34	248	28,182	資本財
PERRIGO CO PLC	30	25	217	24,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,327	1,213	4,389	498,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PVH CORP	20	17	227	25,837	耐久消費財・アパレル
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	340	316	3,390	385,072	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	101	90	829	94,208	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	35	34	486	55,216	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	21	21	194	22,039	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	108	97	1,345	152,834	銀行
RALPH LAUREN CORP	13	11	107	12,152	耐久消費財・アパレル
POLARIS INDUSTRIES INC	14	12	152	17,345	耐久消費財・アパレル
PPL CORP	145	137	518	58,890	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	58	50	589	66,900	素材
PROCTER & GAMBLE CO	561	520	4,520	513,447	家庭用品・パーソナル用品
PRAXAIR INC	61	59	850	96,560	素材
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	64	60	406	46,118	保険
PROGRESSIVE CORP	123	123	600	68,179	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	94	89	993	112,852	保険
PULTE GROUP INC	68	56	165	18,789	耐久消費財・アパレル
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	109	101	500	56,880	公益事業
QUEST DIAGNOSTICS	31	31	293	33,339	ヘルスケア機器・サービス
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	36	27	283	32,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANGE RESOURCES CORP	40	40	73	8,316	エネルギー
RAYTHEON COMPANY	64	58	1,101	125,093	資本財
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	25	25	214	24,340	各種金融
REGIONS FINANCIAL CORP	297	231	360	40,995	銀行
REYNOLDS AMERICAN INC	186	—	—	—	食品・飲料・タバコ
RED HAT INC	—	36	432	49,152	ソフトウェア・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8	8	122	13,922	保険
REPUBLIC SERVICES INC	51	51	325	36,936	商業・専門サービス
RESMED INC	33	29	231	26,266	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			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		
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	13	188	21,364	保険	
REALOLOGY HOLDINGS CORP	31	—	—	—	不動産	
RITE AID CORP	229	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
ROCKWELL AUTOMATION INC	29	26	501	57,001	資本財	
ROBERT HALF INTL INC	23	23	122	13,915	商業・専門サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	21	21	548	62,303	資本財	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	35	35	429	48,731	消費者サービス	
ROCKWELL COLLINS INC.	29	33	455	51,684	資本財	
WESTROCK CO	59	53	324	36,899	素材	
ROLLINS INC	—	16	71	8,063	商業・専門サービス	
SALESFORCE.COM INC	141	137	1,364	154,952	ソフトウェア・サービス	
LEIDOS HOLDINGS INC	—	26	165	18,739	ソフトウェア・サービス	
SCHLUMBERGER LTD	306	281	1,785	202,752	エネルギー	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	19	16	135	15,364	メディア	
SCANA CORP	31	26	127	14,494	公益事業	
SCHWAB (CHARLES) CORP	258	246	1,099	124,916	各種金融	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	39	34	169	19,238	資本財	
SEALED AIR CORP	43	39	176	20,079	素材	
SEMPRA ENERGY	50	48	551	62,665	公益事業	
SERVICENOW INC	36	34	423	48,120	ソフトウェア・サービス	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16	17	685	77,882	素材	
SIGNET JEWELERS LTD	16	15	98	11,158	小売	
SMITH (A. O.) CORP	30	30	178	20,273	資本財	
SNAP-ON INC	12	12	199	22,702	資本財	
SOUTHWEST AIRLINES CO	34	34	194	22,071	運輸	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	104	—	—	—	エネルギー	
SOUTHERN CO	204	198	1,038	117,967	公益事業	
SPECTRA ENERGY CORP	152	—	—	—	エネルギー	
SPRINT CORP	173	173	123	13,990	電気通信サービス	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	5	55	6,296	家庭用品・パーソナル用品	
STANLEY BLACK & DECKER INC	31	31	509	57,870	資本財	
STRYKER CORP	74	70	1,057	120,125	ヘルスケア機器・サービス	
STATE STREET CORP	87	76	716	81,359	各種金融	
ST JUDE MEDICAL INC	61	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SUNTRUST BANKS INC	110	95	571	64,884	銀行	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	27	110	12,570	運輸	
SYSCO CORP	120	105	575	65,335	食品・生活必需品小売り	
SYNCHRONY FINANCIAL	182	163	528	59,978	各種金融	
TARGET CORP	123	106	656	74,541	小売	
TARGA RESOURCES CORP	—	45	183	20,896	エネルギー	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	59	52	262	29,853	各種金融	
ANDEAVOR	28	30	314	35,740	エネルギー	
TEXTRON INC	54	54	290	33,036	資本財	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	196	273	31,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELEFLEX INC	—	9	218	24,779	ヘルスケア機器・サービス	
THE WALT DISNEY CO.	337	317	3,104	352,574	メディア	
COOPER COS INC/THE	10	10	247	28,099	ヘルスケア機器・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	86	79	1,586	180,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TIFFANY & CO	29	26	243	27,709	小売	
TIME WARNER INC	171	157	1,557	176,897	メディア	
TJX COMPANIES INC	145	131	942	107,040	小売	
TOLL BROTHERS INC	37	37	169	19,207	耐久消費財・アパレル	
TORCHMARK CORP	22	22	187	21,286	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	36	36	256	29,079	ソフトウェア・サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	63	59	780	88,660	保険	
TRANSDIGM GROUP INC	11	11	299	34,057	資本財	
TWITTER INC	122	122	210	23,865	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	64	57	407	46,310	食品・飲料・タバコ	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TE CONNECTIVITY LTD	83	69	618	70,220	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JOHNSON CONTROLS INTERNATION UGI CORP	202	188	777	88,266	資本財
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	35	35	166	18,948	公益事業
UNUM GROUP	35	35	56	6,472	耐久消費財・アパレル
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47	47	249	28,390	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	151	140	1,666	189,259	運輸
UNION PACIFIC CORP	173	154	1,841	209,124	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	184	163	1,805	205,082	運輸
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	207	196	4,076	462,965	ヘルスケア機器・サービス
UNITED RENTALS INC	20	18	200	22,765	ヘルスケア機器・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	22	18	255	29,027	資本財
US BANCORP	46	41	60	6,841	耐久消費財・アパレル
VF CORP	377	341	1,848	209,922	銀行
VANTIV INC - CL-A	76	71	505	57,452	耐久消費財・アパレル
VALERO ENERGY CORP	37	32	229	26,103	ソフトウェア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	103	91	712	80,916	エネルギー
VAIL RESORTS INC	23	19	207	23,577	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	—	7	166	18,965	消費者サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	15	—	—	—	素材
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	894	832	4,047	459,694	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	—	19	113	12,863	ヘルスケア機器・サービス
VMWARE INC	418	376	4,119	467,821	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	18	15	184	20,997	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	46	41	166	18,918	各種金融
WAL-MART STORES INC	28	27	335	38,108	素材
WATERS CORP	347	309	2,735	310,725	食品・生活必需品小売り
WABCO HOLDINGS INC	18	16	317	36,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLERGAN PLC	11	11	168	19,172	資本財
WASTE MANAGEMENT INC	86	68	1,229	139,579	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WABTEC CORP	99	91	709	80,580	商業・専門サービス
WASTE CONNECTIONS INC	20	18	145	16,579	資本財
WESTERN UNION CO	38	58	405	46,077	商業・専門サービス
WELLS FARGO & CO	104	104	209	23,774	ソフトウェア・サービス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	1,058	963	5,324	604,759	銀行
ANTHEM INC	201	201	67	7,707	エネルギー
WESTAR ENERGY INC	56	54	1,118	126,998	ヘルスケア機器・サービス
WHIRLPOOL CORP	28	28	151	17,250	公益事業
WHITEWAVE FOODS CO	18	16	259	29,500	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	35	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WEC ENERGY GROUP INC	156	168	478	54,310	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	68	63	421	47,924	公益事業
WR GRACE & CO	25	25	266	30,279	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	14	14	105	11,953	素材
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	20	20	145	16,468	保険
XCEL ENERGY INC	25	22	233	26,538	消費者サービス
XEROX CORP	115	104	514	58,402	公益事業
XL GROUP LTD	197	49	163	18,562	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XYLEM INC	63	57	237	26,952	保険
YUM! BRANDS INC	43	35	228	26,002	資本財
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	92	68	508	57,699	消費者サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	—	37	133	15,161	電気通信サービス
ZOETIS INC	44	41	505	57,411	ヘルスケア機器・サービス
CHENIERE ENERGY INC	102	97	627	71,215	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVR INC	43	40	180	20,523	エネルギー
ACTIVISION BLIZZARD INC	—	0.7	221	25,114	耐久消費財・アパレル
ADOBE SYSTEMS INC	128	146	902	102,488	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	109	100	1,733	196,884	ソフトウェア・サービス
	—	160	197	22,405	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	42	36	199	22,629	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	49	45	599	68,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES PLC	32	32	159	18,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	14	296	33,681	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	32	28	144	16,455	運輸
AMAZON.COM INC	87	82	8,031	912,122	小売
AMGEN INC	164	149	2,655	301,593	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERCO	1	1	60	6,834	運輸
ANALOG DEVICES INC	64	76	685	77,867	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	20	18	241	27,459	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	1,200	1,059	16,575	1,882,431	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	248	218	1,209	137,308	半導体・半導体製造装置
ARCH CAPITAL GROUP LTD	27	27	283	32,180	保険
AUTOMATIC DATA PROCESSING	101	91	1,060	120,447	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	44	41	502	57,074	ソフトウェア・サービス
BED BATH & BEYOND INC	35	30	64	7,285	小売
B/E AEROSPACE INC	25	—	—	—	資本財
BIOGEN INC	48	43	1,363	154,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	35	35	296	33,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM LTD	85	81	2,008	228,088	半導体・半導体製造装置
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	17	110	12,503	保険
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	32	29	227	25,887	運輸
CA INC	67	67	230	26,202	ソフトウェア・サービス
CADENCE DESIGN SYS INC	61	61	260	29,584	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	18	206	23,428	各種金融
CDW CORP/DE	34	29	204	23,249	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CDK GLOBAL INC	27	27	180	20,539	ソフトウェア・サービス
CELGENE CORP	169	158	1,895	215,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	65	62	447	50,801	ヘルスケア機器・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	29	26	308	35,041	ソフトウェア・サービス
CHARTER COMMUNICATION-A	47	44	1,517	172,393	メディア
CINTAS CORP	20	17	259	29,451	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,100	1,016	3,486	395,972	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34	34	257	29,249	保険
CITRIX SYSTEMS INC	36	32	266	30,219	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	75	68	915	103,977	各種金融
COMCAST CORP-CLASS A	529	962	3,544	402,567	メディア
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	132	120	896	101,848	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	96	88	1,439	163,540	食品・生活必需品小売り
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	35	113	12,917	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTAR GROUP INC	—	6	183	20,868	ソフトウェア・サービス
DEXCOM INC	—	17	75	8,628	ヘルスケア機器・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	53	48	295	33,613	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	33	33	63	7,262	メディア
DISH NETWORK CORP-A	47	47	233	26,539	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	56	46	85	9,683	メディア
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	19	195	22,228	エネルギー
DOLLAR TREE INC	48	48	448	50,938	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	58	58	253	28,798	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	—	26	160	18,183	銀行
EBAY INC	245	212	778	88,426	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	239	232	1,651	187,584	ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	65	62	710	80,717	ソフトウェア・サービス
ENDO INTERNATIONAL PLC	41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXPEDIA INC	26	25	377	42,865	小売
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	144	122	749	85,115	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	36	36	214	24,370	運輸

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
F5 NETWORKS INC	14	12	143	16,327	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	506	480	8,192	930,389	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	61	61	286	32,591	資本財
FISERV INC	49	45	577	65,640	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	165	155	443	50,339	銀行
FLIR SYSTEMS INC	31	26	124	14,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	125	109	192	21,896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORTINET INC	31	31	123	13,977	ソフトウェア・サービス
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	257	—	—	—	電気通信サービス
GARMIN LTD	28	23	135	15,381	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	17	17	217	24,658	ソフトウェア・サービス
GILEAD SCIENCES INC	297	265	2,123	241,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	54	54	184	20,936	自動車・自動車部品
ALPHABET INC-CL A	64	60	5,988	680,104	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	67	63	6,172	701,051	ソフトウェア・サービス
HASBRO INC	25	22	215	24,529	耐久消費財・アパレル
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	37	131	14,938	資本財
HENRY SCHEIN INC	18	33	276	31,445	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	57	57	211	24,004	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	20	16	177	20,147	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	242	217	302	34,348	銀行
IDEXX LABORATORIES INC	18	18	296	33,677	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	31	30	619	70,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	53	49	742	84,293	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	1,034	959	3,913	444,436	半導体・半導体製造装置
INTUITIVE SURGICAL INC	8	22	837	95,165	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	36	35	403	45,793	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	11	165	18,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	15	163	18,578	ソフトウェア・サービス
KLA-TENCOR CORPORATION	31	31	341	38,768	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	340	306	1,260	143,159	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	131	122	946	107,504	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	32	32	659	74,884	半導体・半導体製造装置
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	136	123	371	42,216	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	97	89	204	23,275	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62	44	139	15,851	メディア
LINEAR TECHNOLOGY CORP	49	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-C	21	21	195	22,216	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	29	—	—	—	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	19	19	82	9,375	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	49	32	134	15,238	メディア
LKQ CORP	69	63	231	26,268	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	24	20	124	14,169	耐久消費財・アパレル
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	92	80	147	16,716	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	58	58	300	34,182	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	73	73	113	12,894	耐久消費財・アパレル
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	77	65	756	85,915	消費者サービス
IHS MARKIT LTD	75	75	323	36,793	商業・専門サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	41	41	94	10,728	消費者サービス
T-MOBILE US INC	63	60	376	42,777	電気通信サービス
MERCADOLIBRE INC	—	8	179	20,377	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	1,639	1,492	11,736	1,332,928	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	46	46	425	48,376	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	—	11	136	15,513	資本財
MONSTER BEVERAGE CORP	29	82	468	53,194	食品・飲料・タバコ
MYLAN NV	107	95	374	42,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	25	25	185	21,020	各種金融
NAVIENT CORP	86	71	84	9,630	各種金融

銘柄	株数	当期首(前期末)	当 期 末		業 種 等		
			株数	株数		評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	百株		百株	千アメリカドル	千円		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	245		204	534	60,663	メディア	
NETAPP INC	70		52	228	25,992	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	97		95	244	27,722	メディア	
NETFLIX INC	92		87	1,695	192,556	小売	
NEWS CORP - CLASS A	75		75	103	11,743	メディア	
NORTHERN TRUST CORP	46		44	418	47,567	各種金融	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	37		32	176	20,036	消費者サービス	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	58		58	86	9,847	ソフトウェア・サービス	
NVIDIA CORP	115		121	2,350	266,896	半導体・半導体製造装置	
NXP SEMICONDUCTORS NV	63		60	710	80,661	半導体・半導体製造装置	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21		17	359	40,865	小売	
PACCAR INC	76		70	492	55,943	資本財	
PAYCHEX INC	70		65	420	47,755	ソフトウェア・サービス	
PATTERSON COS INC	20		20	81	9,218	ヘルスケア機器・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	63		63	118	13,513	銀行	
PRICELINE GROUP INC/THE	10		9	1,919	217,959	小売	
QORVO INC	31		26	191	21,765	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	324		300	1,615	183,511	半導体・半導体製造装置	
RED HAT INC	40		—	—	—	ソフトウェア・サービス	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16		16	683	77,628	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROSS STORES INC	85		77	493	56,059	小売	
SABRE CORP	45		45	81	9,245	ソフトウェア・サービス	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	25		—	—	—	電気通信サービス	
SEAGATE TECHNOLOGY	69		62	238	27,140	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SEI INVESTMENTS COMPANY	32		27	170	19,363	各種金融	
SEATTLE GENETICS INC	—		20	125	14,223	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	425		342	190	21,627	メディア	
SIGNATURE BANK	9		9	132	15,056	銀行	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	42		39	409	46,553	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	28		28	184	20,936	ソフトウェア・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—		31	131	14,907	ソフトウェア・サービス	
STEEL DYNAMICS INC	—		45	174	19,837	素材	
STARBUCKS CORP	322		293	1,587	180,308	消費者サービス	
STERICYCLE INC	17		17	121	13,825	商業・専門サービス	
STAPLES INC	137		—	—	—	小売	
SVB FINANCIAL GROUP	—		9	186	21,202	銀行	
SYMANTEC CORP	139		130	420	47,711	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSYS INC	32		32	274	31,209	ソフトウェア・サービス	
T ROWE PRICE GROUP INC	54		49	468	53,220	各種金融	
TESLA INC	24		26	866	98,435	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	220		203	1,946	221,040	半導体・半導体製造装置	
TESARO INC	—		6	72	8,247	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRIMBLE INC	60		51	213	24,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	29		27	159	18,089	小売	
TRIPADVISOR INC	23		23	87	9,946	小売	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	19		17	102	11,670	運輸	
ULTA BEAUTY INC	13		12	249	28,347	小売	
UNITED THERAPEUTICS CORP	9		9	115	13,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISIGN INC	22		18	195	22,149	ソフトウェア・サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	53		51	748	85,027	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISK ANALYTICS INC	31		31	266	30,313	商業・専門サービス	
VIACOM INC-CLASS B	77		72	184	20,973	メディア	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	199		186	1,295	147,083	食品・生活必需品小売り	
WESTERN DIGITAL CORP	60		58	510	57,974	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WHOLE FOODS MARKET INC	70		—	—	—	食品・生活必需品小売り	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	27		25	419	47,608	保険	
WYNN RESORTS LTD	16		16	238	27,055	消費者サービス	
XILINX INC	50		50	358	40,760	半導体・半導体製造装置	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
YAHOO! INC	204	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZIONS BANCORPORATION	—	37	172	19,586		銀行
ZILLOW GROUP INC - C	20	20	81	9,221		ソフトウェア・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	237	237	177	20,106		不動産
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	970	970	42	4,847		運輸
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	45	191	21,740		資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	53	43	282	32,036		資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	68,936	63,409	453,960	51,556,312	
		588	599	—	<62.4%>	
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES LTD	46	46	263	23,414		素材
AGRIUM INC	30	27	381	33,833		素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	91	85	511	45,416		食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	30	30	87	7,748		エネルギー
ARC RESOURCES LTD	79	79	120	10,696		エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	19	19	90	8,062		公益事業
BARRICK GOLD CORP	261	239	483	42,899		素材
BANK OF MONTREAL	139	132	1,319	117,113		銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	261	243	2,000	177,501		銀行
BCE INC	29	29	173	15,421		電気通信サービス
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	67	67	104	9,232		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER INC 'B'	347	347	95	8,448		資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	189	181	968	85,922		各種金融
CAE INC	63	63	138	12,328		資本財
CAMECO CORP	78	78	89	7,983		エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	82	87	989	87,831		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	240	231	964	85,560		エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	171	153	1,602	142,185		運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	15	15	248	22,052		小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	25	25	102	9,053		公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6	30	197	17,500		素材
CENOVUS ENERGY INC	174	174	210	18,642		エネルギー
CGI GROUP INC - CL A	46	46	316	28,047		ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	55	46	132	11,791		各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	4	317	28,132		ソフトウェア・サービス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	31	29	649	57,656		運輸
CRESCENT POINT ENERGY CORP	114	114	106	9,490		エネルギー
DOLLARAMA INC	25	21	311	27,661		小売
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	71	71	69	6,161		各種金融
ELDORADO GOLD CORP	146	—	—	—		素材
EMPIRE CO LTD 'A'	30	30	68	6,083		食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	210	210	285	25,351		エネルギー
ENBRIDGE INC	199	335	1,633	144,985		エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4	5	377	33,508		保険
FIRST CAPITAL REALTY INC	—	33	68	6,042		不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	147	147	221	19,619		素材
FINNING INTERNATIONAL INC	28	28	89	7,932		資本財
FORTIS INC	85	80	378	33,571		公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	38	38	384	34,140		素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	54	45	181	16,082		耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	179	179	295	26,218		素材
GREAT-WEST LIFE CO INC	59	59	215	19,105		保険
HUSKY ENERGY INC	68	68	111	9,917		エネルギー
HYDRO ONE LTD	34	62	141	12,542		公益事業
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	17	17	101	9,020		保険
IGM FINANCIAL INC	25	19	87	7,796		各種金融
IMPERIAL OIL LTD	69	59	235	20,889		エネルギー
INTER PIPELINE LTD	71	71	182	16,177		エネルギー

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
INTACT FINANCIAL CORP	24	24	261	23,185	保険	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	234	234	92	8,229	素材	
KEYERA CORP	41	35	129	11,484	エネルギー	
KINROSS GOLD CORP	250	250	126	11,187	素材	
LINAMAR CORP	—	9	77	6,852	自動車・自動車部品	
LOBLAW COMPANIES LTD	49	49	340	30,260	食品・生活必需品小売り	
MANULIFE FINANCIAL CORP	430	412	1,072	95,194	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	83	70	493	43,812	自動車・自動車部品	
METRO INC	57	43	179	15,951	食品・生活必需品小売り	
METHANEX CORP	23	16	107	9,561	素材	
NATIONAL BANK OF CANADA	73	67	418	37,142	銀行	
ONEX CORPORATION	19	19	185	16,484	各種金融	
OPEN TEXT CORP	30	51	221	19,686	ソフトウェア・サービス	
PEMBINA PIPELINE CORP	79	102	415	36,900	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	36	36	65	5,803	エネルギー	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	179	179	450	39,971	素材	
POWER CORP OF CANADA	78	78	256	22,786	保険	
POWER FINANCIAL CORP	57	57	205	18,206	保険	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	53	41	128	11,435	エネルギー	
BLACKBERRY LTD	103	103	142	12,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	49	46	399	35,477	消費者サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	83	71	482	42,821	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	325	295	2,960	262,721	銀行	
SAPUTO INC	50	50	224	19,898	食品・飲料・タバコ	
SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	59	44	78	7,005	エネルギー	
SHOPIFY INC - CLASS-A	—	18	237	21,083	ソフトウェア・サービス	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	96	81	222	19,708	メディア	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	93	93	247	21,984	素材	
SNC-LAVALIN GROUP INC	31	31	182	16,237	資本財	
SUN LIFE FINANCIAL INC	133	129	652	57,937	保険	
SUNCOR ENERGY INC	362	338	1,428	126,795	エネルギー	
TELUS CORP	43	43	205	18,248	電気通信サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	138	119	350	31,062	素材	
THOMSON REUTERS CORP	80	55	334	29,696	各種金融	
TOURMALINE OIL CORP	45	45	102	9,114	エネルギー	
TORONTO-DOMINION BANK	406	373	2,694	239,103	銀行	
TRANSCANADA CORP	176	176	1,055	93,658	エネルギー	
VERESEN INC	53	—	—	—	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	26	26	110	9,839	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	14	116	10,370	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	11	11	129	11,487	食品・生活必需品小売り	
YAMANA GOLD INC	196	196	63	5,642	素材	
小計	株数・金額	8,659	8,367	35,761	3,173,448	
銘柄数<比率>		87	88	—	<3.8%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG	41	38	713	95,799	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE-REG	99	92	1,824	244,846	保険	
AXEL SPRINGER SE	9	9	57	7,662	メディア	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	71	66	567	76,204	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	11	11	87	11,778	自動車・自動車部品	
BASF SE	200	186	1,694	227,438	素材	
BAYER AG	181	167	1,919	257,554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIERSDORF AG	20	20	183	24,594	家庭用品・パーソナル用品	
BRENTNAG AG	37	30	149	20,093	資本財	
COMMERZBANK AG	235	213	259	34,811	銀行	
CONTINENTAL AG	23	22	475	63,866	自動車・自動車部品	
COVESTRO AG	13	21	168	22,548	素材	
DAIMLER AG	210	194	1,349	181,132	自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE BOERSE AG	—	40	361	48,566	各種金融	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	303	424	617	82,825	各種金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	209	200	767	102,924	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	704	664	1,023	137,294	電気通信サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	75	75	263	35,370	不動産	
VONOVIA SE	100	92	337	45,266	不動産	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	40	—	—	—	各種金融	
E. ON SE	440	446	437	58,699	公益事業	
EVONIK INDUSTRIES AG	35	35	107	14,469	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRAPORT AG	46	43	353	47,394	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG	9	9	77	10,431	運輸	
FRESENIUS SE & CO KGAA	90	86	612	82,243	ヘルスケア機器・サービス	
FUCHS PETROLUB SE-PRF	17	17	80	10,866	素材	
GEA GROUP AG	39	39	158	21,225	資本財	
HANNOVER RUECK SE-REG	13	13	142	19,173	保険	
HEIDELBERGCEMENT AG	32	28	244	32,851	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	39	37	434	58,263	家庭用品・パーソナル用品	
HENKEL AG & CO KGAA	21	18	191	25,743	家庭用品・パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	4	4	64	8,705	資本財	
HUGO BOSS AG -ORD	14	12	94	12,687	耐久消費財・アパレル	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	247	234	531	71,274	半導体・半導体製造装置	
INNOGY SE	28	28	109	14,731	公益事業	
K+S AG	38	38	80	10,746	素材	
KION GROUP AG	—	14	91	12,256	資本財	
LANXESS AG	19	19	130	17,472	素材	
LINDE AG	41	36	674	90,514	素材	
DEUTSCHE LUFTHANSA	56	56	154	20,689	運輸	
MAN SE	8	8	77	10,443	資本財	
MERCK KGAA	29	26	240	32,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CECONOMY AG	41	—	—	—	小売	
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	—	41	68	9,185	食品・生活必需品小売り	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	36	30	577	77,440	保険	
OSRAM LICHT AG	19	15	98	13,234	資本財	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	34	31	183	24,592	自動車・自動車部品	
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	48	48	141	18,956	メディア	
QIAGEN N.V.	51	43	123	16,516	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE AG	106	106	220	29,565	公益事業	
SAP SE	216	199	1,907	255,917	ソフトウェア・サービス	
SCHAEFFLER AG-PRF	35	35	48	6,447	自動車・自動車部品	
SIEMENS AG-REG	168	155	1,785	239,598	資本財	
SYMRISE AG	26	26	172	23,214	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	160	122	53	7,170	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG	74	74	170	22,870	素材	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	29	29	155	20,889	ソフトウェア・サービス	
VOLKSWAGEN AG	7	5	88	11,868	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	40	38	556	74,711	自動車・自動車部品	
ZALANDO SE	17	17	70	9,403	小売	
小 計	株 数	金 額	4,979	4,852	24,333	3,265,344
銘 柄	株 数 < 比 率 >	57	58	—	< 4.0% >	
(ユーロ…イタリア)						
ATLANTIA SPA	93	93	255	34,314	運輸	
ENEL SPA	1,670	1,646	842	113,114	公益事業	
ENI SPA	540	513	708	95,120	エネルギー	
EXOR SPA	29	—	—	—	各種金融	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	96	81	123	16,626	資本財	
UNIPOLSAI SPA	185	185	36	4,901	保険	
ASSICURAZIONI GENERALI	258	239	374	50,313	保険	
INTESA SANPAOLO	2,922	2,709	784	105,303	銀行	

銘柄	株数	当期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INTESA SANPAOLO-RSP	—	200	54	7,267	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	39	34	163	21,901	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	116	116	107	14,360	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	102	102	63	8,542	保険	
PRYSMIAN SPA	51	34	99	13,333	資本財	
RECORDATI SPA	—	17	68	9,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAIPEM SPA	1,235	123	42	5,744	エネルギー	
SNAM SPA	594	461	192	25,832	エネルギー	
TELECOM ITALIA SPA	2,397	2,332	176	23,657	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,258	1,258	77	10,389	電気通信サービス	
TERNA SPA	344	276	138	18,588	公益事業	
UBI BANCA SPA	225	—	—	—	銀行	
UNICREDIT SPA	1,103	397	696	93,449	銀行	
小計	株数・金額	13,268	10,825	5,007	671,955	
銘柄数<比率>		19	19	—	<0.8%>	
(ユーロ…フランス)						
ACCOR SA	41	34	145	19,512	消費者サービス	
ADP	6	6	90	12,158	運輸	
AIR LIQUIDE SA	84	89	956	128,385	素材	
ALSTOM	35	35	125	16,832	資本財	
ARKEMA	16	13	141	18,926	素材	
ATOS SE	20	20	268	36,060	ソフトウェア・サービス	
AXA	421	397	1,015	136,307	保険	
SOCIETE BIC SA	7	5	47	6,339	商業・専門サービス	
BNP PARIBAS	231	227	1,533	205,841	銀行	
BOLLORE	204	204	82	11,032	運輸	
BOUYGUES SA	42	42	169	22,707	資本財	
BUREAU VERITAS SA	56	56	125	16,880	商業・専門サービス	
CAP GEMINI SA	36	31	321	43,186	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA	122	122	213	28,598	食品・生活必需品小売り	
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	13	66	8,864	食品・生活必需品小売り	
CHRISTIAN DIOR SE	13	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	35	35	70	9,431	保険	
CREDIT AGRICOLE SA	219	219	335	45,033	銀行	
DANONE	130	123	848	113,823	食品・飲料・タバコ	
DASSAULT SYSTEMES SA	27	27	251	33,732	ソフトウェア・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	—	0.5	66	8,922	資本財	
EDENRED	39	39	93	12,490	商業・専門サービス	
EIFFAGE	11	11	99	13,328	資本財	
EDF	60	78	87	11,803	公益事業	
ESSILOR INTERNATIONAL	44	42	436	58,540	ヘルスケア機器・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	37	37	88	11,812	メディア	
EURAZEO SE	9	10	77	10,432	各種金融	
ORANGE S. A.	433	415	563	75,676	電気通信サービス	
ENGIE	325	352	502	67,365	公益事業	
GROUPE EURO TUNNEL SE - REGR	87	87	92	12,366	運輸	
HERMES INTERNATIONAL	6	6	268	36,052	耐久消費財・アパレル	
ILIAD SA	5	5	110	14,796	電気通信サービス	
IMERYS SA	8	8	63	8,579	素材	
INGENICO GROUP	11	11	94	12,689	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
IPSEN	—	6	72	9,683	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JC DECAUX SA	19	12	38	5,144	メディア	
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	60	57	1,396	187,378	耐久消費財・アパレル	
L'OREAL	55	51	933	125,318	家庭用品・パーソナル用品	
LAGARDERE S. C. A.	29	29	83	11,252	メディア	
LEGRAND SA	56	56	343	46,144	資本財	
MICHELIN (CGDE)-B	41	36	454	60,994	自動車・自動車部品	
NATIXIS	229	191	131	17,600	各種金融	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SPR GROUP SA	22	—	—	—	電気通信サービス	
PERNOD-RICARD SA	46	44	555	74,496	食品・飲料・タバコ	
PEUGEOT SA	98	98	196	26,373	自動車・自動車部品	
KERING	18	16	634	85,114	耐久消費財・アパレル	
PUBLICIS GROUPE	40	40	224	30,146	メディア	
REXEL SA	72	62	90	12,186	資本財	
RENAULT SA	41	34	288	38,726	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	4	4	49	6,704	食品・飲料・タバコ	
SAFRAN SA	67	65	571	76,756	資本財	
SANOFI	255	230	1,879	252,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	105	101	510	68,511	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	119	114	836	112,266	資本財	
SCOR SE	31	31	111	14,939	保険	
SEB SA	—	4	77	10,395	耐久消費財・アパレル	
SODEXO	19	19	208	27,981	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	176	154	747	100,301	銀行	
SUEZ	61	61	92	12,473	公益事業	
TECHNIP SA	24	—	—	—	エネルギー	
THALES SA	23	23	207	27,817	資本財	
TOTAL SA	488	481	2,208	296,306	エネルギー	
VALEO SA	48	48	281	37,812	自動車・自動車部品	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	91	91	182	24,487	公益事業	
VINCI SA	109	103	836	112,221	資本財	
VIVENDI	253	205	421	56,544	メディア	
WENDEL	7	6	83	11,251	各種金融	
ZODIAC AEROSPACE	45	45	110	14,882	資本財	
小 計	株数・金額	5,614	5,346	24,315	3,262,958	
	銘柄数<比率>	65	65		<4.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
ABN AMRO GROUP NV-CVA	46	71	190	25,506	銀行	
AEGON NV	381	381	193	25,932	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	282	264	421	56,554	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	58	50	393	52,859	素材	
ALTICE NV -A	83	83	143	19,282	メディア	
ALTICE NV -B	19	19	33	4,481	メディア	
ASML HOLDING NV	79	76	1,152	154,687	半導体・半導体製造装置	
BOSKALIS WESTMINSTER	16	16	51	6,866	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV	223	223	231	31,038	資本財	
AIRBUS GROUP SE	126	118	988	132,707	資本財	
EXOR NV	—	22	119	15,980	各種金融	
FERRARI NV	31	23	231	31,111	自動車・自動車部品	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	196	196	282	37,964	自動車・自動車部品	
GEMALTO	18	18	58	7,812	ソフトウェア・サービス	
HEINEKEN NV	50	52	434	58,312	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	21	21	165	22,173	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV-CVA	851	794	1,267	170,059	銀行	
KONINKLIJKE DSM NV	38	38	278	37,434	素材	
KONINKLIJKE KPN NV	750	656	194	26,094	電気通信サービス	
NN GROUP NV	71	63	226	30,406	保険	
OCI NV	20	—	—	—	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	198	192	657	88,281	ヘルスケア機器・サービス	
RANDSTAD HOLDING NV	28	22	117	15,791	商業・専門サービス	
RELX NV	205	205	380	51,051	商業・専門サービス	
UNILEVER NV-CVA	357	333	1,573	211,143	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	12	12	45	6,164	エネルギー	
WOLTERS KLUWER	69	62	255	34,247	商業・専門サービス	
小 計	株数・金額	4,241	4,023	10,089	1,353,947	
	銘柄数<比率>	26	26	—	<1.6%>	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	130	120	226	30,345	運輸	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	41	41	135	18,212	資本財	
AENA SA	14	14	223	30,001	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA	96	93	527	70,814	ソフトウェア・サービス	
BANKIA SA	950	237	95	12,878	銀行	
BANKINTER SA	139	139	110	14,894	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,423	1,359	986	132,395	銀行	
BANCO SANTANDER SA	3,150	3,256	1,834	246,134	銀行	
BANCO POPULAR ESPANOL	758	—	—	—	銀行	
BANCO DE SABADELL SA	1,096	1,096	177	23,816	銀行	
BANCO SANTANDER SA-RTS	—	3,256	12	1,704	銀行	
CAIXABANK S.A	685	767	297	39,934	銀行	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	110	110	47	6,379	食品・生活必需品小売り	
ENDESA SA	68	68	127	17,154	公益事業	
ENAGAS SA	56	56	134	18,064	エネルギー	
FERROVIAL SA	99	99	177	23,759	資本財	
GAS NATURAL SDG SA	77	77	141	18,931	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	—	41	45	6,074	資本財	
GRIFOLS SA	68	68	165	22,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	1,178	1,178	775	104,019	公益事業	
INDITEX	242	227	694	93,231	小売	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	169	128	96	12,909	運輸	
MAPPRE SA	208	208	55	7,435	保険	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	104	90	162	21,817	公益事業	
REPSOL SA	247	247	378	50,796	エネルギー	
TELEFONICA SA	984	946	837	112,437	電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS SA	44	—	—	—	資本財	
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額		
	銘柄	銘柄	数 < 比率 >	数 < 比率 >		
			12,148	13,933	8,467	1,136,304
			25	25	—	< 1.4% >
(ユーロ…ベルギー)						
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	176	154	1,592	213,660	食品・飲料・タバコ	
PROXIMUS	37	24	68	9,228	電気通信サービス	
COLRUYT SA	13	13	60	8,091	食品・生活必需品小売り	
AGEAS	40	40	167	22,458	保険	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	18	14	129	17,396	各種金融	
KBC GROEP NV	55	51	367	49,320	銀行	
SOLVAY SA	15	15	195	26,201	素材	
TELENET GROUP HOLDING NV	12	12	70	9,506	メディア	
UCB SA	27	27	170	22,846	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE	21	42	159	21,441	素材	
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額		
	銘柄	銘柄	数 < 比率 >	数 < 比率 >		
			419	397	2,981	400,151
			10	10	—	< 0.5% >
(ユーロ…オーストリア)						
ANDRITZ AG	19	14	67	9,012	資本財	
ERSTE GROUP BANK AG	64	64	242	32,604	銀行	
IMMOEAST AG-TEMPORARY	161	—	—	—	不動産	
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	130	—	—	—	不動産	
OMV AG	34	34	173	23,303	エネルギー	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	27	27	82	11,021	銀行	
VOESTALPINE AG	25	25	116	15,660	素材	
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額		
	銘柄	銘柄	数 < 比率 >	数 < 比率 >		
			463	166	682	91,601
			7	5	—	< 0.1% >
(ユーロ…ルクセンブルク)						
ARCELORMITTAL	389	129	330	44,309	素材	
EUROFINS SCIENTIFIC	—	2	118	15,934	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RTL GROUP	9	6	39	5,351	メディア	
SES	86	75	124	16,675	メディア	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等
		株数	価 値	
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額
		株数	千ユーロ	千円
(ユーロ…ルクセンブルク)	百株	百株		
TENARIS SA	93	93	103	13,896
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	578	307	716
		4	5	<0.1%>
(ユーロ…フィンランド)				
ELISA OYJ	25	25	87	11,718
FORTUM OYJ	98	88	157	21,127
KONE OYJ-B	74	64	297	39,971
METSO OYJ	24	24	74	9,985
NESTE OYJ	27	27	115	15,516
NOKIA OYJ	1,260	1,199	611	82,114
NOKIAN RENKAAT OYJ	29	19	77	10,360
ORION OYJ-CLASS B	25	18	70	9,486
SAMPO OYJ-A SHS	96	91	414	55,567
STORA ENSO OYJ-R SHS	120	120	158	21,211
UPM-KYMMENE OYJ	126	108	279	37,500
WARTSILA OYJ ABP	32	29	169	22,724
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,941	1,817	2,513
		12	12	<0.4%>
(ユーロ…アイルランド)				
BANK OF IRELAND GROUP PLC	5,585	186	117	15,700
CRH PLC	190	171	538	72,300
KERRY GROUP PLC-A	33	33	280	37,668
PADDY POWER BETFAIR PLC	18	16	137	18,430
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,828	407	1,073
		4	4	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)				
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	549	549	162	21,768
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	93	93	142	19,187
JERONIMO MARTINS	50	50	80	10,746
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	693	693	385
		3	3	<0.1%>
(ユーロ…イギリス)				
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	49	49	170	22,902
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	49	49	170
		1	1	<0.0%>
(ユーロ…スイス)				
STMICROELECTRONICS NV	127	127	225	30,277
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	127	127	225
		1	1	<0.0%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	50,352	42,947	80,965
		234	234	<13.2%>
(イギリス)				
3I GROUP PLC	204	204	193	29,119
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	77	73	243	36,750
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	227	—	—	—
ADMIRAL GROUP PLC	49	32	62	9,401
AGGREKO PLC	60	—	—	—
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	70	70	41	6,268
ANGLO AMERICAN PLC	302	270	383	57,709
ANTOFAGASTA PLC	87	87	86	12,966
ASTRAZENECA PLC	277	256	1,303	196,346
ASHTED GROUP PLC	109	99	191	28,810
AUTO TRADER GROUP PLC	233	179	64	9,723
AVIVA PLC	892	842	422	63,699
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	408	466	2,260	340,494
BAE SYSTEMS PLC ORD	696	655	386	58,151
BARCLAYS PLC	3,640	3,383	666	100,418
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	229	229	159	24,095
			千イギリスポンド	
				各種金融
				食品・飲料・タバコ
				各種金融
				保険
				商業・専門サービス
				ヘルスケア機器・サービス
				素材
				素材
				医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
				資本財
				ソフトウェア・サービス
				保険
				食品・飲料・タバコ
				資本財
				銀行
				耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
BABCOCK INTL GROUP PLC	62	62	51	7,737	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	26	26	103	15,580	耐久消費財・アパレル
BHP BILLITON PLC	459	427	577	87,040	素材
BP PLC	4,082	3,991	1,946	293,243	エネルギー
SKY PLC	232	213	200	30,128	メディア
BT GROUP PLC	1,831	1,733	459	69,226	電気通信サービス
BUNZL PLC	72	72	163	24,562	資本財
BURBERRY GROUP PLC	103	89	170	25,739	耐久消費財・アパレル
CAPITA PLC	153	153	79	12,015	商業・専門サービス
CARNIVAL PLC	44	40	200	30,217	消費者サービス
CENTRICA PLC	1,190	1,111	186	28,118	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI	50	35	91	13,732	食品・飲料・タバコ
COBHAM PLC	348	487	66	10,072	資本財
COMPASS GROUP PLC	366	324	511	77,081	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	—	277	57	8,651	ヘルスケア機器・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	27	27	107	16,240	素材
DCC PLC	18	18	128	19,386	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	293	293	108	16,305	保険
DIAGEO PLC	551	509	1,294	195,031	食品・飲料・タバコ
DIXONS CARPHONE PLC	220	220	40	6,034	小売
EASYJET PLC	38	38	50	7,554	運輸
EXPERIAN PLC	205	186	287	43,330	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	51	39	53	8,090	素材
GKN PLC	330	330	104	15,709	自動車・自動車部品
G4S PLC	346	346	97	14,641	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	2,668	2,503	942	141,926	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,066	1,000	1,430	215,417	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	57	89	13,407	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	28	28	31	4,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	4,352	4,063	3,014	454,103	銀行
ICAP PLC	122	—	—	—	各種金融
IMI PLC	61	61	76	11,507	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	210	192	601	90,552	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	40	38	156	23,526	消費者サービス
INVESTEC PLC	131	131	69	10,397	各種金融
INMARSAT PLC	100	100	61	9,281	電気通信サービス
INTERTEK GROUP PLC	35	35	185	27,902	商業・専門サービス
ITV PLC	772	772	131	19,790	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	41	41	142	21,474	素材
KINGFISHER PLC	503	452	141	21,352	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,270	1,158	309	46,574	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,109	14,501	985	148,417	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	65	65	248	37,450	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	349	349	119	18,053	小売
MEGGITT PLC	139	139	71	10,766	資本財
MERLIN ENTERTAINME	155	155	57	8,622	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	87	220	33,196	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC	74	74	135	20,444	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	492	492	113	17,065	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	822	683	616	92,941	公益事業
NEXT PLC	29	29	146	22,025	小売
OLD MUTUAL PLC	1,041	1,041	198	29,874	保険
PETROFAC LTD	50	—	—	—	エネルギー
PERSIMMON PLC	70	70	201	30,284	耐久消費財・アパレル
PEARSON PLC	177	177	125	18,849	メディア
PROVIDENT FINANCIAL PLC	33	—	—	—	各種金融
PRUDENTIAL PLC	565	522	964	145,296	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	22	18	134	20,317	素材

銘柄	株数	期首(前期末)				業種等
		株数	株数	当 期 末		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	139	131	864	130,294	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	236	206	348	52,450	商業・専門サービス	
RIO TINTO PLC	270	252	883	133,073	素材	
ROYAL MAIL PLC	199	199	75	11,380	運輸	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	795	720	201	30,413	銀行	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	937	899	2,079	313,270	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	820	767	1,807	272,330	エネルギー	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	434	330	310	46,742	資本財	
RSA INSURANCE GROUP PLC	247	214	135	20,337	保険	
SAINSBURY (J) PLC	447	324	79	11,933	食品・生活必需品小売り	
SAGE GROUP PLC/THE	244	204	150	22,706	ソフトウェア・サービス	
SCHRODERS PLC	29	19	66	10,015	各種金融	
SSE PLC	214	197	266	40,078	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	54	44	91	13,838	公益事業	
SHIRE PLC	197	186	671	101,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	88	88	136	20,604	資本財	
SMITH & NEPHEW PLC	193	187	265	39,958	ヘルスケア機器・サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	110	110	128	19,304	各種金融	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	407	531	228	34,479	各種金融	
STANDARD CHARTERED PLC	722	656	498	75,132	銀行	
TATE & LYLE PLC	105	105	67	10,235	食品・飲料・タバコ	
TAYLOR WIMPEY PLC	736	736	150	22,742	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	1,778	1,711	317	47,839	食品・生活必需品小売り	
TRAVIS PERKINS PLC	58	58	87	13,184	資本財	
TUI AG-DI	112	99	132	19,995	消費者サービス	
UNILEVER PLC	281	260	1,064	160,359	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	162	133	109	16,429	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	5,810	5,418	1,157	174,364	電気通信サービス	
WEIR GROUP PLC/THE	38	38	81	12,332	資本財	
WHITBREAD PLC	41	35	129	19,545	消費者サービス	
WILLIAM HILL PLC	180	—	—	—	消費者サービス	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	130	90	13,669	エネルギー	
FERGUSON PLC	55	53	277	41,824	資本財	
WORLDPAY GROUP PLC	421	421	173	26,114	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	289	251	333	50,304	メディア	
(イギリス…非上場)						
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C(N)	19,975	—	—	—	資本財	
小 計	株数・金額	85,173	62,685	38,791	5,843,529	
	銘柄数<比率>	107	103	—	<7.1%>	
(スイス)				千スイスフラン		
ABB LTD-REG	425	401	995	114,212	資本財	
ACTELION LTD-REG	23	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	35	35	271	31,166	商業・専門サービス	
ARYZTA AG	21	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG - REG	10	10	167	19,235	保険	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	411	500	798	91,682	各種金融	
DUFREY AG-REG	10	6	104	11,964	小売	
VIFOR PHARMA AG	0.7	10	132	15,226	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GEBERIT AG-REG	8	8	373	42,837	資本財	
GIVAUDAN-REG	2	1	399	45,824	素材	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	99	93	530	60,898	素材	
JULIUS BAER GROUP LTD	52	46	269	30,934	各種金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	11	11	195	22,395	運輸	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	—	0.02	135	15,593	食品・飲料・タバコ	
LONZA GROUP AG-REG	12	16	411	47,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NESTLE SA-REG	698	631	5,152	591,309	食品・飲料・タバコ	
NOVARTIS AG-REG	490	452	3,642	417,962	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	—	3	246	28,279	各種金融	

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	118	104	943	108,313	耐久消費財・アパレル	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	154	142	3,270	375,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	9	216	24,879	資本財	
SGS SA-REG	1	1	266	30,565	商業・専門サービス	
SIKA AG-BR	0.47	0.47	339	38,996	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	11	11	202	23,256	ヘルスケア機器・サービス	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	6	6	221	25,375	保険	
SWISSCOM AG-REG	5	5	248	28,520	電気通信サービス	
SWISS RE AG	74	65	599	68,751	保険	
SYNGENTA AG-REG	21	—	—	—	素材	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	6	6	271	31,128	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG-REG	798	748	1,278	146,709	各種金融	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	33	31	939	107,788	保険	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.45	0.45	67	7,761	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	1	107	12,320	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.25	0.18	101	11,640	食品・飲料・タバコ	
PARGESA HOLDING SA-BR	6	6	54	6,201	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3	—	—	—	各種金融	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	3	3	78	9,047	資本財	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	1	113	12,973	ヘルスケア機器・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	18	14	122	14,099	不動産	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	13	9	70	8,137	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額	3,604	3,404	23,340	2,678,556	
	銘柄数<比率>	38	36	—	<3.2%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB	69	54	1,108	15,327	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	209	209	3,554	49,161	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	151	137	4,970	68,746	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	86	76	2,514	34,771	資本財	
BOLIDEN AB	72	59	1,687	23,333	素材	
ELECTROLUX AB - B	54	54	1,496	20,693	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	642	642	3,475	48,060	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	130	2,930	40,535	家庭用品・パーソナル用品	
GETINGE AB-B SHS	44	44	703	9,730	ヘルスケア機器・サービス	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	205	187	4,018	55,579	小売	
HEXAGON AB-B SHS	59	52	2,143	29,651	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUSQVARNA AB-B SHS	84	84	659	9,118	耐久消費財・アパレル	
ICA GRUPPEN AB	14	14	447	6,182	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	44	27	570	7,886	各種金融	
INVESTOR AB-B SHS	101	91	3,758	51,975	各種金融	
KINNEVIK AB - B	55	42	1,133	15,673	各種金融	
LUNDBERGS AB-B SHS	—	7	447	6,190	各種金融	
LUNDIN PETROLEUM AB	43	43	807	11,166	エネルギー	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	13	13	726	10,041	電気通信サービス	
NORDEA BANK AB	646	626	6,745	93,283	銀行	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	318	318	3,250	44,957	銀行	
SANDVIK AB	216	216	3,242	44,845	資本財	
SECURITAS AB-B SHS	72	58	838	11,591	商業・専門サービス	
SKANSKA AB-B SHS	71	71	1,309	18,106	資本財	
SKF AB-B SHARES-B	89	78	1,435	19,857	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	130	—	—	—	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	326	312	3,715	51,380	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	199	179	3,681	50,908	銀行	
SWEDISH MATCH AB	48	40	1,207	16,694	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	62	62	652	9,022	電気通信サービス	
TELIA CO AB	534	534	2,019	27,935	電気通信サービス	

銘柄	株数	金額	当期		業種等
			株数	金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千	千	
VOLVO AB-B SHS-B	339	326	千スウェーデンクローナ	千円	資本財
小計	5,009	4,798	5,382	74,438	
銘柄数 < 比率 >	30	31	70,632	976,851	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	222	199	3,147	44,597	銀行
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	42	42	607	8,605	保険
MARINE HARVEST	77	77	1,244	17,634	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO A S	309	264	1,655	23,452	素材
ORKLA ASA	193	173	1,435	20,346	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-CL A	16	16	349	4,954	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	24	14	276	3,920	メディア
STATOIL ASA	246	232	3,859	54,693	エネルギー
TELENOR ASA	173	148	2,573	36,471	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	37	37	1,428	20,246	素材
小計	1,342	1,206	16,578	234,922	
銘柄数 < 比率 >	10	10	—	< 0.3% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
AP MOELLER - MAERSK A/S - B	1	1	1,614	29,111	運輸
AP MOELLER - MAERSK A/S - A	0.9	0.8	906	16,342	運輸
CARLSBERG AS-B	23	21	1,570	28,319	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	18	18	1,020	18,401	素材
COLOPLAST-B	25	25	1,403	25,306	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	149	156	3,843	69,294	銀行
DONG ENERGY A/S	—	29	1,091	19,671	公益事業
DSV A/S	43	38	1,794	32,362	運輸
GENMAB A/S	12	11	1,523	27,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S	—	10	423	7,633	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	31	31	829	14,956	商業・専門サービス
NOVO NORDISK A/S-B	416	372	11,827	213,249	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES	48	48	1,658	29,902	素材
PANDORA A/S	25	23	1,357	24,470	耐久消費財・アパレル
TDC A/S	145	145	556	10,038	電気通信サービス
TRYG A/S	25	25	383	6,908	保険
VESTAS WIND SYSTEMS AS	46	44	2,399	43,268	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING	30	30	534	9,644	ヘルスケア機器・サービス
小計	1,045	1,036	34,739	626,348	
銘柄数 < 比率 >	16	18	—	< 0.8% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
AGL ENERGY LTD	153	128	321	28,143	公益事業
ALUMINA LTD	465	465	113	9,885	素材
AMCOR LIMITED	264	238	379	33,173	素材
AMP LTD	626	626	316	27,669	各種金融
AUST AND NZ BANKING GROUP	638	593	1,811	158,421	銀行
ARISTOCRAT LEISURE LTD	125	108	253	22,191	消費者サービス
ASX LTD	49	34	186	16,318	各種金融
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	104	104	126	11,024	銀行
BHP BILLITON LTD	702	657	1,764	154,336	素材
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	81	81	108	9,495	銀行
BLUESCOPE STEEL LTD	—	98	128	11,222	素材
BORAL LTD	171	171	124	10,852	素材
BRAMBLES LTD	355	328	304	26,647	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LTD	53	53	182	15,976	エネルギー
CHALLENGER LTD	99	99	133	11,678	各種金融
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	375	350	2,759	241,361	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	106	106	84	7,432	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	12	12	217	18,979	ヘルスケア機器・サービス
COMPUTERSHARE LTD	114	114	173	15,154	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	67	67	76	6,660	消費者サービス

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
CSL LTD	100	95	1,324	115,872		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	11	11	56	4,927		消費者サービス
DUET GROUP	540	—	—	—		公益事業
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	9	9	46	4,024		消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	296	296	149	13,102		素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	143	—	—	—		小売
HEALTHSCOPE LTD	443	330	63	5,554		ヘルスケア機器・サービス
INCITEC PIVOT LTD	315	315	119	10,457		素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	502	502	332	29,121		保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	109	85	162	14,185		素材
CIMIC GROUP LTD	18	18	88	7,743		資本財
SYDNEY AIRPORT	241	241	173	15,169		運輸
MACQUARIE GROUP LTD	67	64	609	53,303		各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	620	620	190	16,701		保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	581	541	1,767	154,580		銀行
NEWCREST MINING LTD	172	154	336	29,422		素材
OIL SEARCH LTD	364	288	208	18,230		エネルギー
ORIGIN ENERGY LTD	419	359	273	23,895		エネルギー
ORICA LIMITED	69	69	144	12,658		素材
QANTAS AIRWAYS LTD	131	70	45	3,970		運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	293	293	322	28,162		保険
AURIZON HOLDINGS LTD	461	461	233	20,423		運輸
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29	29	192	16,877		ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	11	11	82	7,186		メディア
RIO TINTO LTD	99	87	607	53,098		素材
SANTOS LTD	376	331	144	12,606		エネルギー
SEEK LTD	80	80	146	12,776		商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD	98	81	174	15,285		ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	1,176	1,060	344	30,157		素材
AUSNET SERVICES	407	407	71	6,290		公益事業
SUNCORP GROUP LTD	290	271	371	32,472		保険
TABCORP HOLDINGS LTD	153	153	66	5,848		消費者サービス
TATTS GROUP LTD	377	300	122	10,700		消費者サービス
TELSTRA CORPORATION LTD	931	873	307	26,901		電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	72	—	—	—		電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP	431	431	521	45,598		運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	159	159	238	20,849		食品・飲料・タバコ
VOCUS GROUP LTD	120	—	—	—		電気通信サービス
WESTPAC BANKING CORP	731	679	2,266	198,256		銀行
WESFARMERS LTD	244	236	981	85,873		食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS LTD	276	267	673	58,888		食品・生活必需品小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD	165	154	456	39,898		エネルギー
小計	株数・金額	16,717	14,894	23,984	2,097,699	
	銘柄数<比率>	61	58	—	<2.5%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	245	214	135	10,598		運輸
CONTACT ENERGY LIMITED	193	153	85	6,713		公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	171	151	116	9,093		素材
MERIDIAN ENERGY LTD	280	280	79	6,177		公益事業
MERCURY NZ LTD	—	135	46	3,621		公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD	85	85	76	5,974		ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	451	351	128	10,035		電気通信サービス
小計	株数・金額	1,426	1,371	668	52,214	
	銘柄数<比率>	6	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
AIA GROUP LTD	2,642	2,463	14,561	211,871		保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	42	42	482	7,015		半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA	216	216	744	10,831		銀行

銘柄	株数	期		末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	770	770	2,956	43,021	銀行	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	250	—	—	—	運輸	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	130	892	12,985	公益事業	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	582	567	5,676	82,592	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	602	557	3,570	51,956	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	380	345	2,742	39,907	公益事業	
FIRST PACIFIC CO	442	—	—	—	各種金融	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	500	500	2,655	38,630	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	570	460	845	12,301	不動産	
HANG LUNG GROUP LTD	—	170	473	6,888	不動産	
HANG SENG BANK LTD	163	146	2,733	39,766	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	268	251	1,277	18,589	不動産	
HKT TRUST AND HKT LTD	670	540	514	7,479	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS	325	285	1,932	28,114	公益事業	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	560	560	402	5,850	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	1,799	1,715	2,531	36,834	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	245	236	5,192	75,543	各種金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO	150	150	570	8,304	不動産	
I-CABLE COMMUNICATIONS LTD	—	350	8	117	メディア	
KERRY PROPERTIES LTD	114	114	399	5,814	不動産	
LI & FUNG LTD	1,380	1,380	549	7,991	耐久消費財・アパレル	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	168	168	292	4,258	消費者サービス	
MTR CORP	340	340	1,533	22,310	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,346	1,346	1,578	22,964	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	285	285	441	6,427	資本財	
PCCW LTD	800	800	341	4,970	電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	498	498	1,879	27,353	消費者サービス	
SINO LAND CO	630	630	881	12,824	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	480	480	325	4,735	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	334	304	3,968	57,741	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	130	105	808	11,767	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	232	232	626	9,114	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	290	290	1,284	18,692	耐久消費財・アパレル	
WHEELLOCK & CO LTD	196	196	1,077	15,670	不動産	
WHARF HOLDINGS LTD	278	248	1,783	25,944	不動産	
WH GROUP LTD	1,535	1,535	1,198	17,443	食品・飲料・タバコ	
WYNN MACAU LTD	358	358	717	10,443	消費者サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	145	145	437	6,360	耐久消費財・アパレル	
小計	株数	金額	金額	金額		
	20,869	19,912	70,888	1,031,432		
	39	39	—	<1.2%>		
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND LTD	686	518	192	16,092	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	100	100	126	10,580	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	460	460	92	7,682	運輸	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	367	367	815	68,066	銀行	
GENTING SINGAPORE PLC	1,565	1,145	137	11,474	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	600	600	197	16,484	不動産	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,300	1,300	51	4,288	食品・飲料・タバコ	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	20	20	79	6,617	小売	
KEPPEL CORP LTD	346	290	216	18,079	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	682	615	710	59,357	銀行	
SEMCORP INDUSTRIES LTD	210	210	68	5,734	資本財	
SINGAPORE AIRLINES LTD	128	128	130	10,913	運輸	
SATS LTD	—	130	60	5,026	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	200	123	93	7,775	各種金融	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	325	325	87	7,339	メディア	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,721	1,721	642	53,632	電気通信サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	330	330	113	9,452	資本財	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等		
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額 邦貨換算金額			
(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	292	263	646	54,029	銀行	
UOL GROUP LTD	122	122	108	9,073	不動産	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	447	296	98	8,248	食品・飲料・タバコ	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,903 19	9,066 20	4,669 -	389,951 <0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
BANK LEUMI LE-ISRAEL	364	244	474	15,355	銀行	
BANK HAPOALIM BM	277	212	520	16,853	銀行	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	487	487	262	8,496	電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	-	5	263	8,519	資本財	
FRUTAROM	-	8	226	7,341	素材	
ISRAEL CHEMICALS LTD	97	97	143	4,636	素材	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	-	29	179	5,817	銀行	
NICE LTD	13	13	396	12,826	ソフトウェア・サービス	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	200	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,442 6	1,098 8	2,466 -	79,847 <0.1%>	
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	274,484 1,241	234,199 1,251	- -	79,605,811 <96.4%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	1,490	181	20,648	0.0	
PROLOGIS INC	11,402	10,932	699	79,496	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	9,269	8,589	1,179	133,958	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	7,010	7,010	150	17,068	0.0	
VEREIT INC	24,234	19,554	152	17,321	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	20,020	237	26,920	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,085	2,855	515	58,519	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3,417	3,147	382	43,421	0.1	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,800	6,100	109	12,400	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	1,940	176	20,100	0.0	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	10,000	125	14,241	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,430	8,010	834	94,717	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	4,135	508	57,752	0.1	
DUKE REALTY CORPORATION	6,875	6,875	197	22,479	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,980	7,530	503	57,194	0.1	
EQUINIX INC	1,478	1,628	745	84,667	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	1,400	360	40,962	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	2,450	197	22,440	0.0	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	1,415	174	19,809	0.0	
GGP INC	12,545	12,545	258	29,349	0.0	
HCP INC	10,125	9,285	235	26,742	0.0	
WELLTOWER INC	7,680	7,380	488	55,485	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	16,589	15,169	293	33,335	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	5,515	5,515	219	24,934	0.0	
KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	8,795	162	18,468	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	3,113	133	15,131	0.0	
MACERICH CO/THE	2,870	2,460	138	15,673	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,500	2,270	236	26,868	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	2,990	121	13,844	0.0	
PUBLIC STORAGE	3,209	3,039	638	72,479	0.1	
REALTY INCOME CORP	5,400	5,400	294	33,405	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	2,355	3,175	199	22,691	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	2,580	377	42,920	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,814	6,374	1,043	118,487	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	2,260	2,040	195	22,195	0.0	
UDR INC	5,820	5,820	222	25,255	0.0	
VENTAS INC	7,285	7,285	448	50,882	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	3,811	3,491	254	28,867	0.0	
WEYERHAEUSER CO	16,498	15,508	537	61,079	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	244,464	249,314	13,931	1,582,219	
	銘柄 数 < 比 率 >	36	39	—	<1.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	2,340	50	4,472	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	3,380	83	7,366	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	5,720	5,720	133	11,839	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)			千ユーロ	千円	%	
FONCIERE DES REGIONS	595	595	50	6,777	0.0	
GECINA SA	970	970	130	17,559	0.0	
ICADE	685	685	50	6,719	0.0	
KLEPIERRE	4,732	4,732	152	20,468	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	2,070	425	57,054	0.1	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	9,052	9,052	809	108,579	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	21,701	131	19,744	0.0	
HAMMERSON PLC	15,295	15,295	78	11,842	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	15,214	144	21,829	0.0	
INTU PROPERTIES PLC	19,860	19,860	42	6,363	0.0	
SEGRO PLC	15,053	18,063	96	14,557	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	88,138	90,133	493	74,338	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
APA GROUP	26,406	21,286	181	15,917	0.0	
VICINITY CENTRES	72,862	72,862	192	16,823	0.0	
DEXUS	18,487	18,487	177	15,521	0.0	
GOODMAN GROUP	39,332	39,332	327	28,620	0.0	
GPT GROUP	44,885	33,695	168	14,705	0.0	
LENLEASE GROUP	12,197	12,197	201	17,654	0.0	
MIRVAC GROUP	86,525	86,525	205	17,934	0.0	
SCENTRE GROUP	116,381	116,381	470	41,121	0.0	
STOCKLAND	55,310	55,310	247	21,623	0.0	
WESTFIELD CORP	41,745	41,745	323	28,331	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	514,130	497,820	2,495	218,255	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<0.3%>	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	48,000	48,000	3,156	45,919	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	48,000	48,000	3,156	45,919	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	51,900	141	11,832	0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	40,000	67	5,595	0.0	
CAPITACOMMERCIAL TRUST(N)	—	6,640	11	928	0.0	
CAPITALAND MALL TRUST	66,300	48,100	97	8,154	0.0	
SUNTEC REIT	45,000	45,000	86	7,252	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	203,200	191,640	404	33,763	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,112,704	1,091,679	—	2,074,915	
	銘 柄 数 < 比 率 >	63	67	—	<2.5%>	

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

リミテッドパートナー（出資金）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	5,400	2,027	千アメリカドル	千円	%
			39	4,502	0.0
合 計	口 数 ・ 金 額	5,400	2,027	39	4,502
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	DJSTX5	百万円	百万円
		SP EMINI	189	—
			653	—

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

○投資信託財産の構成

(2017年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 79,605,811	% 96.2
投資証券	2,074,915	2.5
リミテッドパートナー(出資金)	4,502	0.0
コール・ローン等、その他	1,062,861	1.3
投資信託財産総額	82,748,089	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（82,355,272千円）の投資信託財産総額（82,748,089千円）に対する比率は99.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=113.57円、1カナダドル=88.74円、1ユーロ=134.19円、1イギリスポンド=150.64円、1スイスフラン=114.76円、1スウェーデンクローナ=13.83円、1ノルウェークローネ=14.17円、1デンマーククローネ=18.03円、1オーストラリアドル=87.46円、1ニュージーランドドル=78.10円、1香港ドル=14.55円、1シンガポールドル=83.51円、1イスラエルシケル=32.37円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	83,573,091,733	
コール・ローン等	781,768,626	
株式(評価額)	79,605,811,014	
投資証券(評価額)	2,074,915,029	
リミテッドパートナー(出資金)(評価額)	4,502,837	
未収入金	843,192,148	
未収配当金	63,655,859	
差入委託証拠金	199,246,220	
(B) 負債	1,015,848,733	
未払金	856,001,707	
未払解約金	159,846,558	
未払利息	468	
(C) 純資産総額(A-B)	82,557,243,000	
元本	34,878,791,197	
次期繰越損益金	47,678,451,803	
(D) 受益権総口数	34,878,791,197口	
1万円当たり基準価額(C/D)	23,670円	

(注) 当ファンドの期首元本額は38,877,746,606円、期中追加設定元本額は2,431,074,859円、期中一部解約元本額は6,430,030,268円です。

(注) 2017年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	15,103,205,248円
・日興五大陸株式ファンド	5,838,410,861円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	5,576,111,060円
・インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,232,881,019円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,448,288,498円
・DCインデックスバランス(株式80)	381,859,625円
・DCインデックスバランス(株式60)	350,897,322円
・インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	200,803,262円
・DCインデックスバランス(株式40)	179,902,285円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式30)	118,739,544円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	116,134,275円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	114,014,686円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	81,059,833円
・DCインデックスバランス(株式20)	58,050,502円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	27,315,219円
・全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	27,231,067円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	7,204,167円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,633,016円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,718,625円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	4,331,083円

(注) 1口当たり純資産額は2,3670円です。

○損益の状況（2016年10月27日～2017年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	1,781,481,992	
受取配当金	1,772,254,315	
受取利息	88,627	
その他収益金	9,430,545	
支払利息	△ 291,495	
(B) 有価証券売買損益	19,748,189,657	
売買益	21,841,009,863	
売買損	△ 2,092,820,206	
(C) 先物取引等取引損益	206,732,551	
取引益	226,341,823	
取引損	△ 19,609,272	
(D) 保管費用等	△ 19,750,893	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	21,716,653,307	
(F) 前期繰越損益金	30,337,043,255	
(G) 追加信託差損益金	2,714,293,027	
(H) 解約差損益金	△ 7,089,537,786	
(I) 計(E+F+G+H)	47,678,451,803	
次期繰越損益金(I)	47,678,451,803	

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

(注) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2016年10月27日から2017年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。