

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年5月15日

【計算期間】 第16期
(自 平成29年2月16日 至 平成30年2月15日)

【ファンド名】 D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 >

【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目 8 番 2 号

【事務連絡者氏名】 三木谷 正直

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目 8 番 2 号

【電話番号】 03-6774-5100

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

当ファンドの信託金の限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドに投資を行い、「MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」*に連動する投資成果をめざして運用を行います。

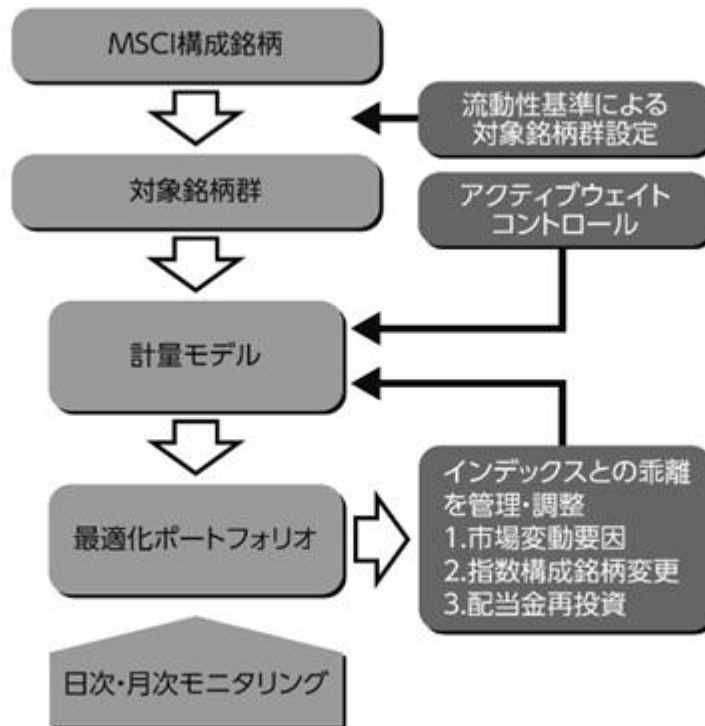
本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含む。)については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

2

流動性を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



3

株式への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

4

実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

分配方針

年1回の決算時(毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日。))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回	グローバル (日本を除く) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCIコクサイ ・インデックス (円換算ベース、 配当込み、為替 ヘッジなし))
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注)当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル(日本を除く)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ)にのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。

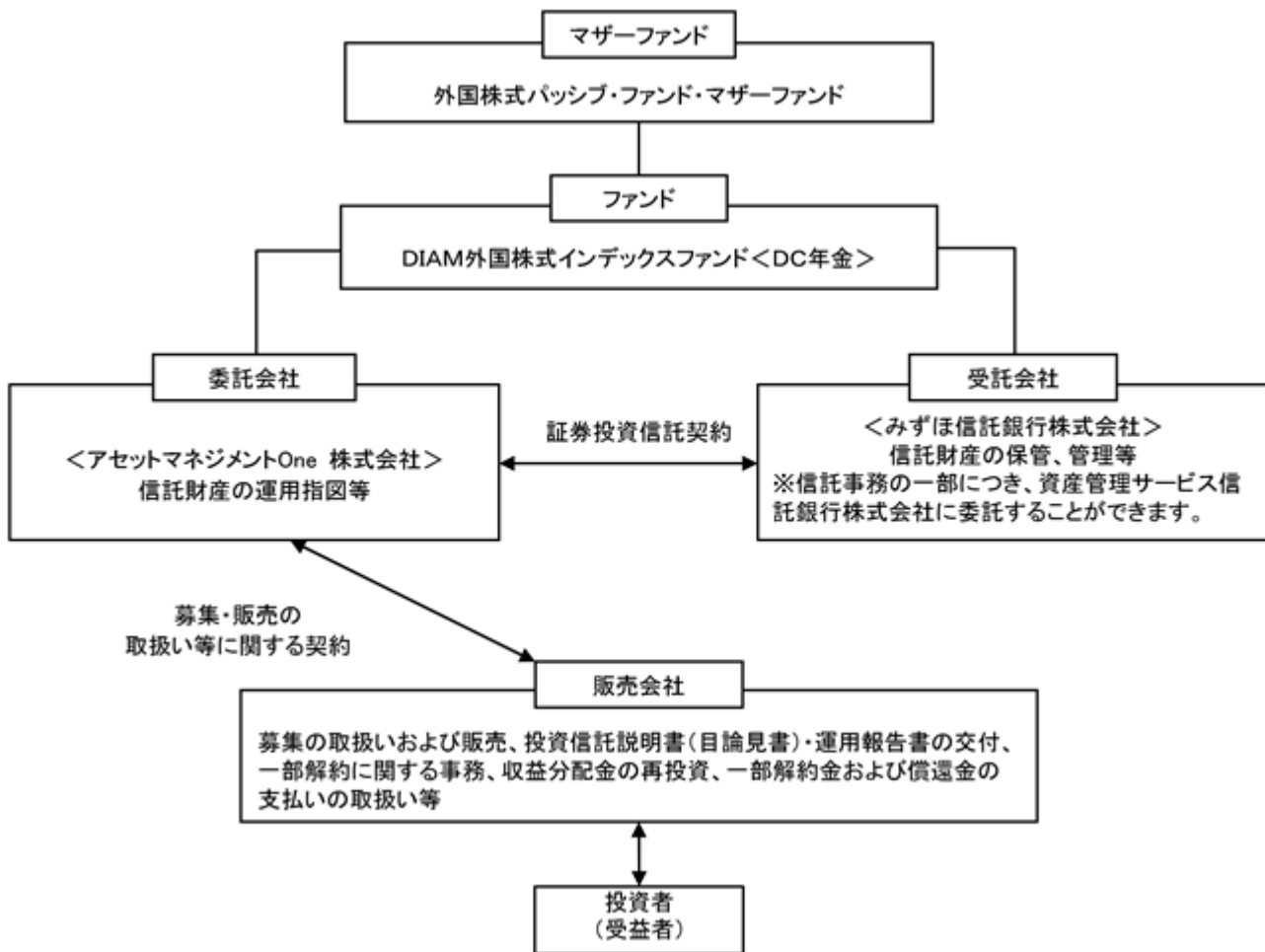
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ
(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成14年9月5日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

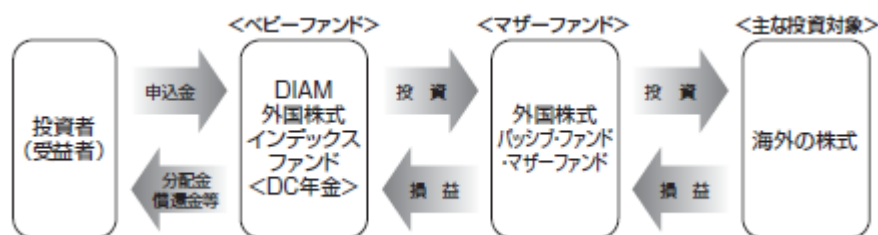
- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資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、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行います。



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成30年2月28日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日 会社設立

平成10年3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

平成10年12月1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更

平成28年10月1日 DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（平成30年2月28日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

<投資対象>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

- 1)主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2)株式への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3)実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限りません。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1) 株券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。 ）の新株引受権証券を除きます。 ）

- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 - 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 - 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 - 10) コマーシャル・ペーパー
 - 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 - 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)~11)の証券または証書の性質を有するもの
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 - 19) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1)、12)ならびに15)の証券または証書のうち1)の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および12)ならびに15)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

4. 金融商品の指図範囲（約款第16条第3項）

上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

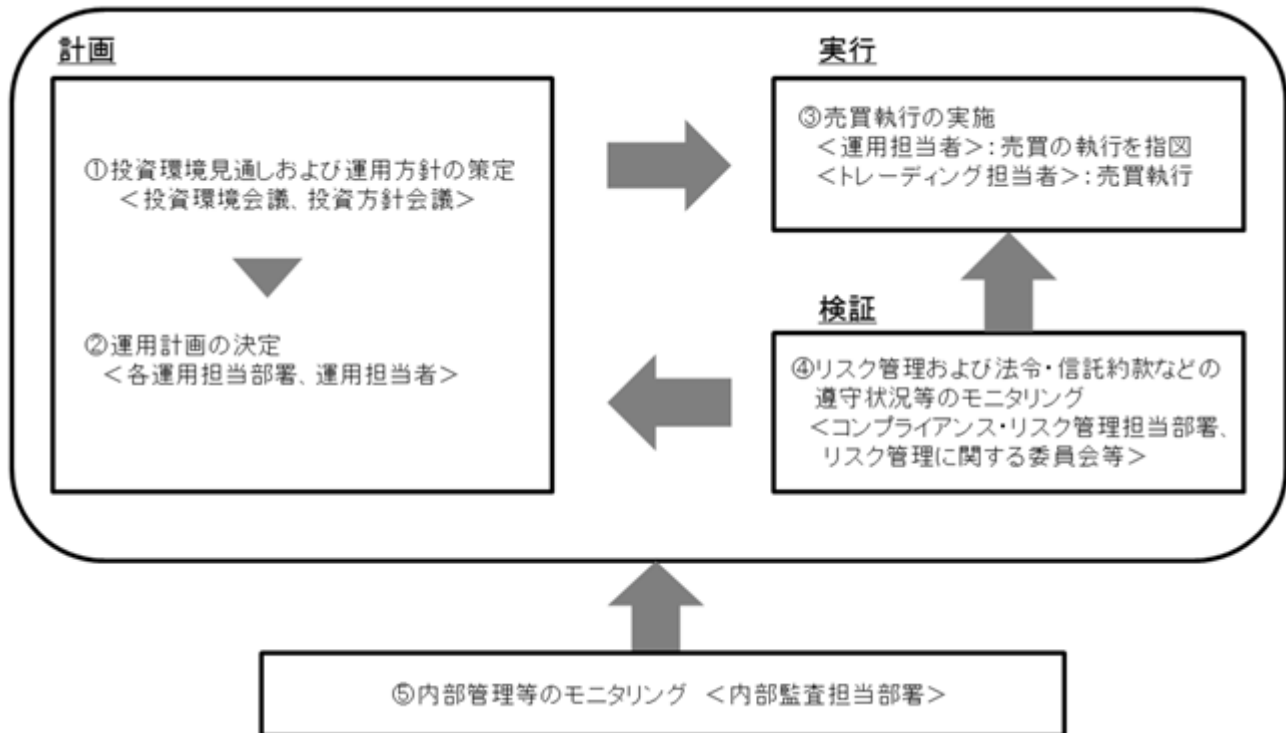
（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに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以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

運用計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的で開催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b．ファンドの関係法人に関する管理

当ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c．運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は平成30年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年2月15日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

留保金の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

a．信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下、「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に

かかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、別に定める契約に基づき、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。

3) 同一銘柄の転換社債等への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。

4) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

6) 投資する株式等の範囲(約款第18条)

a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当

たは社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

7) 信用取引の指図範囲(約款第20条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- b. 上記a.の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

8) 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月

までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

b. 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに別に定める外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲内で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

c. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産

の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。) の合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本項で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

9) スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- d. 上記c.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- e. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- f. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
 - b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - c. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 - d. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 - e. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 - f. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 12) 有価証券の貸付けの指図および範囲(約款第24条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - b. 上記a.1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- 13) 特別の場合の外貨建資産への投資制限(約款第25条)
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 14) 外貨為替予約の指図(約款第26条)
- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

- b. 上記a.の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、原則として信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- c. 上記b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

15) 資金の借入れ(約款第33条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

16) 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律 第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

当ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク

当ファンドでは実質的に株式に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に大きく影響します。

信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額とMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)が乖離する場合があります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

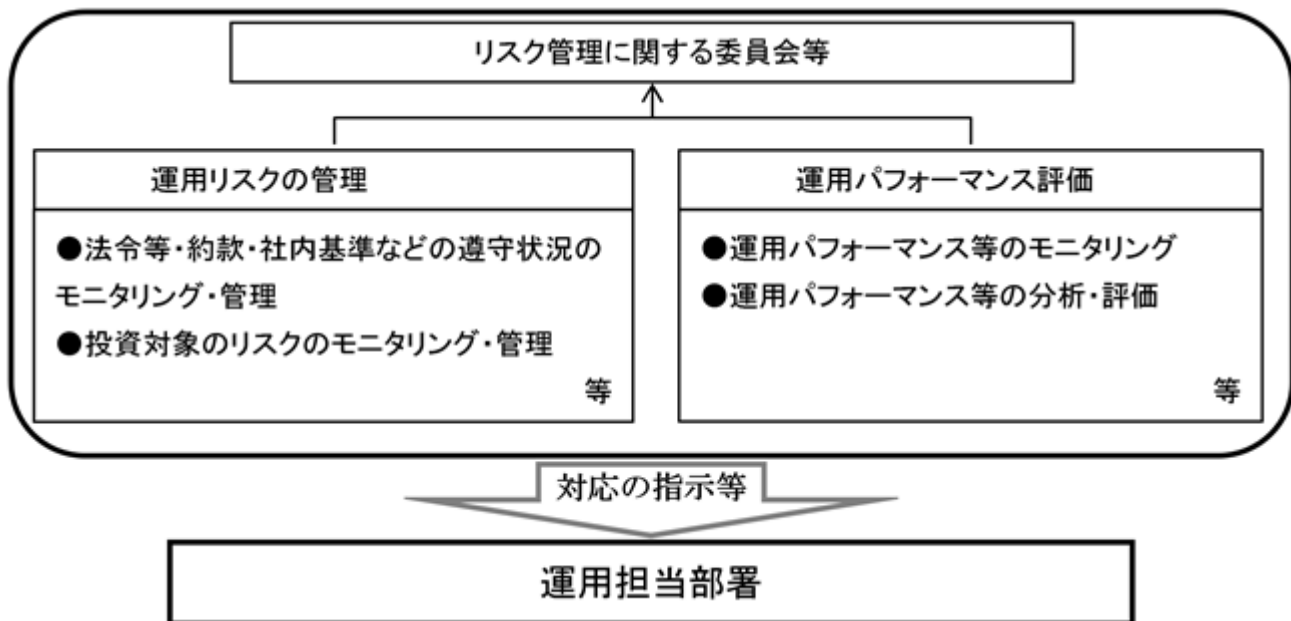
注意事項

- イ. 当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

委託会社における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下の通りです。

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



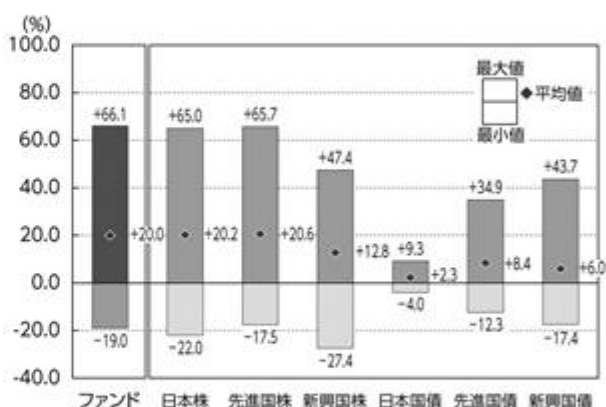
上記体制は平成30年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2013年3月～2018年2月

* ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

* ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

* 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

* 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日 本 株…東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 日本国債…NOMURA-BPI国債
 - 先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)
- (注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

●「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。

●「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産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。

●「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産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。

●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.27%(税抜0.25%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.11%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.11%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎年8月15日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎年8月15日(休業日の場合は翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、平成30年2月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成30年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	127,296,973,958	100.00
内 日本	127,296,973,958	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,844,232	0.00
純資産総額	127,299,818,190	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	286,173,090,987	97.44
内 アメリカ	178,926,704,906	60.92
内 イギリス	19,270,615,827	6.56
内 フランス	11,620,806,991	3.96
内 ドイツ	11,473,849,910	3.91
内 カナダ	10,896,325,528	3.71
内 スイス	10,362,906,983	3.53
内 オーストラリア	7,094,651,100	2.42
内 オランダ	5,864,497,198	2.00
内 アイルランド	4,057,470,709	1.38
内 スペイン	3,857,272,468	1.31
内 スウェーデン	3,200,115,002	1.09
内 香港	2,767,810,549	0.94
内 イタリア	2,406,166,766	0.82
内 シンガポール	2,281,374,714	0.78
内 デンマーク	2,181,758,622	0.74
内 ジャージー	1,568,225,550	0.53
内 ベルギー	1,318,254,447	0.45
内 バミューダ	1,270,990,705	0.43
内 フィンランド	1,221,808,470	0.42
内 ケイマン諸島	858,433,122	0.29
内 ノルウェー	791,841,832	0.27
内 オランダ領キュラソー	751,452,468	0.26
内 イスラエル	541,509,407	0.18
内 ルクセンブルグ	397,021,972	0.14
内 オーストリア	310,570,432	0.11
内 パナマ	180,551,334	0.06
内 ポルトガル	173,596,253	0.06
内 リベリア	170,082,237	0.06
内 ニュージーランド	168,853,271	0.06
内 イギリス領バージン諸島	68,021,897	0.02

	内 パプアニューギニア	59,193,486	0.02
	内 マン島	40,161,571	0.01
	内 モーリシャス	20,195,260	0.01
投資信託受益証券		738,432,349	0.25
	内 オーストラリア	632,205,635	0.22
	内 シンガポール	106,226,714	0.04
投資証券		5,827,208,323	1.98
	内 アメリカ	4,959,508,082	1.69
	内 フランス	376,449,028	0.13
	内 イギリス	296,300,288	0.10
	内 香港	151,306,987	0.05
	内 カナダ	43,643,938	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		957,300,842	0.33
純資産総額		293,696,032,501	100.00

その他資産の投資状況

平成30年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	11,201,152,060	3.81
-	11,201,152,060	3.81
株価指数先物取引(買建)	9,205,215,959	3.13
内 アメリカ	6,253,980,390	2.13
内 ドイツ	1,690,356,028	0.58
内 イギリス	639,648,505	0.22
内 カナダ	343,496,568	0.12
内 オーストラリア	277,734,468	0.09

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注4) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成30年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	37,527,482,668	3.3307 124,993,153,645	3.3921 127,296,973,958	- -	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	376,451	18,007.81 6,779,058,734	19,153.73 7,210,442,430	- -	2.46%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	538,221	9,764.85 5,255,651,395	10,114.25 5,443,703,902	- -	1.85%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,086	156,072.83 4,695,607,413	162,341.29 4,884,200,129	- -	1.66%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	176,000	19,285.06 3,394,170,575	19,483.36 3,429,071,395	- -	1.17%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	255,246	12,356.95 3,154,064,430	12,600.94 3,216,340,348	- -	1.10%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	197,470	13,931.34 2,751,022,846	14,137.40 2,791,713,938	- -	0.95%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,200	115,056.93 2,669,320,970	120,070.79 2,785,642,497	- -	0.95%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	21,721	115,359.60 2,505,726,035	119,987.04 2,606,238,684	- -	0.89%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	312,038	8,214.28 2,563,168,936	8,321.17 2,596,522,804	- -	0.88%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	729,453	3,436.85 2,507,021,003	3,471.27 2,532,129,847	- -	0.86%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	344,273	6,392.66 2,200,821,734	6,357.37 2,188,673,492	- -	0.75%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	93,679	21,573.43 2,020,977,551	22,511.19 2,108,826,161	- -	0.72%
13	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	228,092	8,832.57 2,014,640,421	8,678.41 1,979,477,079	- -	0.67%
14	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	344,152	4,890.71 1,683,148,550	5,358.83 1,844,254,367	- -	0.63%

15	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	71,700	24,582.76 1,762,583,899	24,965.67 1,790,038,711	- -	0.61%
16	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	451,718	3,911.46 1,766,876,944	3,958.73 1,788,230,456	- -	0.61%
17	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	134,179	12,982.02 1,741,914,914	13,246.23 1,777,366,821	- -	0.61%
18	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	364,860	4,528.19 1,652,156,158	4,835.94 1,764,442,819	- -	0.60%
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	440,550	3,786.52 1,668,152,157	3,951.21 1,740,708,208	- -	0.59%
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,514	19,831.29 1,715,685,015	19,861.30 1,718,280,733	- -	0.59%
21	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	139,524	12,200.38 1,702,245,970	12,198.30 1,701,956,404	- -	0.58%
22	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	41,769	37,139.71 1,551,288,764	39,151.39 1,635,314,692	- -	0.56%
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	186,535	8,662.09 1,615,783,870	8,647.57 1,613,076,297	- -	0.55%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	193,450	8,236.35 1,593,322,429	8,200.92 1,586,468,090	- -	0.54%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,472,712	1,118.00 1,646,499,581	1,073.47 1,580,923,813	- -	0.54%
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	300,563	5,309.02 1,595,695,007	5,158.05 1,550,320,424	- -	0.53%
27	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	118,243	12,169.38 1,438,944,445	12,697.57 1,501,399,502	- -	0.51%
28	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	163,931	9,071.59 1,487,115,075	9,126.51 1,496,117,976	- -	0.51%
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	298,559	4,732.90 1,413,050,178	4,683.47 1,398,294,926	- -	0.48%
30	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	345,846	4,222.77 1,460,430,545	3,936.18 1,361,313,560	- -	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年2月28日現在

種類	投資比率
株式	97.44%
投資信託受益証券	0.25%
投資証券	1.98%
合計	99.67%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.89%
石油・ガス・消耗燃料		5.88%
医薬品		5.18%
ソフトウェア		4.32%
保険		4.06%
インターネットソフトウェア・サービス		3.41%
情報技術サービス		3.20%
資本市場		3.20%
半導体・半導体製造装置		3.12%
コンピュータ・周辺機器		2.80%
化学		2.69%
航空宇宙・防衛		2.45%
インターネット販売・通信販売		2.34%
バイオテクノロジー		2.25%
メディア		2.24%
ヘルスケア機器・用品		2.16%
各種電気通信サービス		2.06%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.98%
飲料		1.97%
食品		1.81%
ホテル・レストラン・レジャー		1.78%
機械		1.73%
電力		1.69%
金属・鉱業		1.63%
食品・生活必需品小売り		1.63%
コングロマリット		1.62%
専門小売り		1.55%
タバコ		1.25%
繊維・アパレル・贅沢品		1.25%
家庭用品		1.18%
各種金融サービス		1.05%
自動車		1.05%
総合公益事業		0.95%
通信機器		0.94%
陸運・鉄道		0.93%
電気設備		0.78%
パーソナル用品		0.68%
専門サービス		0.62%

ライフサイエンス・ツール/サービス	0.58%
航空貨物・物流サービス	0.57%
不動産管理・開発	0.54%
エネルギー設備・サービス	0.53%
消費者金融	0.52%
自動車部品	0.52%
電子装置・機器・部品	0.49%
家庭用耐久財	0.47%
建設関連製品	0.42%
複合小売り	0.40%
商業サービス・用品	0.37%
建設・土木	0.35%
無線通信サービス	0.33%
商社・流通業	0.33%
建設資材	0.32%
容器・包装	0.30%
運送インフラ	0.28%
旅客航空輸送業	0.14%
ガス	0.13%
紙製品・林産品	0.11%
水道	0.07%
販売	0.07%
海運業	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
レジャー用品	0.06%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.05%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	97.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年03月	買建	68,466,000	7,343,510,547	7,350,509,760	2.50%
		ユーロ買/円売201 8年03月	買建	12,706,000	1,669,594,838	1,668,043,680	0.57%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年03月	買建	5,457,000	814,574,529	814,457,250	0.28%
		カナダ・ドル買/円売 2018年03月	買建	5,824,000	489,828,459	489,565,440	0.17%

		オーストラリア・ドル 買/円売2018年0 3月	買建	4,399,000	368,306,787	367,939,570	0.13%
		スイス・フラン買/円 売2018年03月	買建	2,186,000	249,896,962	249,881,660	0.09%
		香港・ドル買/円売2 018年03月	買建	7,350,000	100,768,500	100,695,000	0.03%
		スウェーデン・クロ ーナ買/円売2018年 03月	買建	6,180,000	80,596,470	80,587,200	0.03%
		デンマーク・クロー ネ買/円売2018年0 3月	買建	2,870,000	50,600,970	50,598,100	0.02%
		ノルウェー・クロー ネ買/円売2018年0 3月	買建	2,120,000	28,895,600	28,874,400	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T M a r 1 8	買建	424	6,194,447,751	6,253,980,390	2.13%
	EUREX 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 M a r 1 8	買建	373	1,668,675,136	1,690,356,028	0.58%
	ICE-E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E M a r 1 8	買建	59	634,390,076	639,648,505	0.22%
	モン トリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T M a r 1 8	買建	22	337,302,291	343,496,568	0.12%
	シド ニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S M a r 1 8	買建	22	269,358,010	277,734,468	0.09%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成30年2月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第7計算期間末 (平成21年2月16日)	15,060	15,060	0.9062	0.9062
第8計算期間末 (平成22年2月15日)	28,396	28,396	1.2246	1.2246
第9計算期間末 (平成23年2月15日)	39,647	39,647	1.4110	1.4110
第10計算期間末 (平成24年2月15日)	41,707	41,707	1.3008	1.3008
第11計算期間末 (平成25年2月15日)	60,080	60,080	1.7592	1.7592
第12計算期間末 (平成26年2月17日)	75,426	75,426	2.3012	2.3012
第13計算期間末 (平成27年2月16日)	98,769	98,769	2.9168	2.9168
第14計算期間末 (平成28年2月15日)	82,214	82,214	2.4126	2.4126
第15計算期間末 (平成29年2月15日)	107,765	107,765	3.0461	3.0461
第16計算期間末 (平成30年2月15日)	123,694	123,694	3.3421	3.3421
平成29年2月末日	106,712	-	3.0211	-
3月末日	108,743	-	3.0498	-
4月末日	109,253	-	3.0705	-
5月末日	111,010	-	3.1167	-
6月末日	113,206	-	3.1650	-
7月末日	114,619	-	3.1884	-
8月末日	114,744	-	3.1757	-
9月末日	119,839	-	3.3226	-
10月末日	123,319	-	3.3988	-
11月末日	124,934	-	3.4212	-
12月末日	129,624	-	3.5267	-
平成30年1月末日	133,141	-	3.5652	-
2月末日	127,299	-	3.4039	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第7計算期間	50.6
第8計算期間	35.1
第9計算期間	15.2
第10計算期間	7.8
第11計算期間	35.2
第12計算期間	30.8
第13計算期間	26.8
第14計算期間	17.3
第15計算期間	26.3
第16計算期間	9.7

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

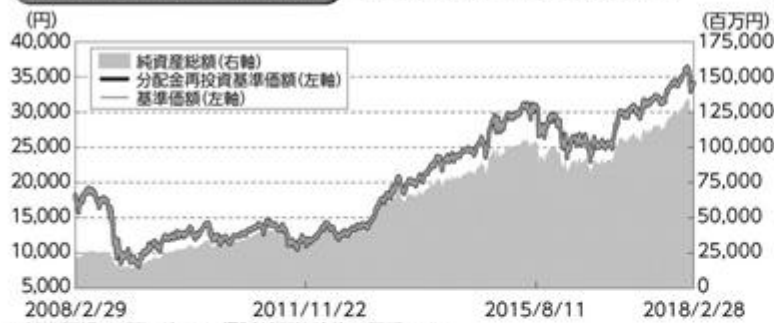
	設定口数	解約口数
第7計算期間	6,532,134,419	2,772,322,990
第8計算期間	9,353,757,517	2,783,451,128
第9計算期間	8,936,687,787	4,025,800,144
第10計算期間	9,290,705,463	5,326,900,557
第11計算期間	8,170,299,501	6,081,641,525
第12計算期間	8,496,275,034	9,870,472,114
第13計算期間	8,954,460,215	7,869,839,615
第14計算期間	7,855,082,565	7,640,340,280
第15計算期間	7,253,514,984	5,952,570,108
第16計算期間	8,373,163,615	6,739,828,907

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2018年2月28日

基準価額・純資産の推移 (2008年2月29日～2018年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年9月5日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第12期	(2014.02.17)	0円
第13期	(2015.02.16)	0円
第14期	(2016.02.15)	0円
第15期	(2017.02.15)	0円
第16期	(2018.02.15)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	100.00%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.44
内 アメリカ	60.92
内 イギリス	6.56
内 フランス	3.96
内 ドイツ	3.91
内 カナダ	3.71
内 その他	18.38
投資信託受益証券	0.25
内 オーストラリア	0.22
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.98
内 アメリカ	1.69
内 フランス	0.13
内 イギリス	0.10
内 香港	0.05
内 カナダ	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	0.33
合計(純資産総額)	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.46%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.85%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.66%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	1.17%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.10%
6	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.95%
7	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	0.95%
8	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	0.89%
9	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	0.88%
10	BANK OF AMERICA CORP	株式	アメリカ	銀行	0.86%

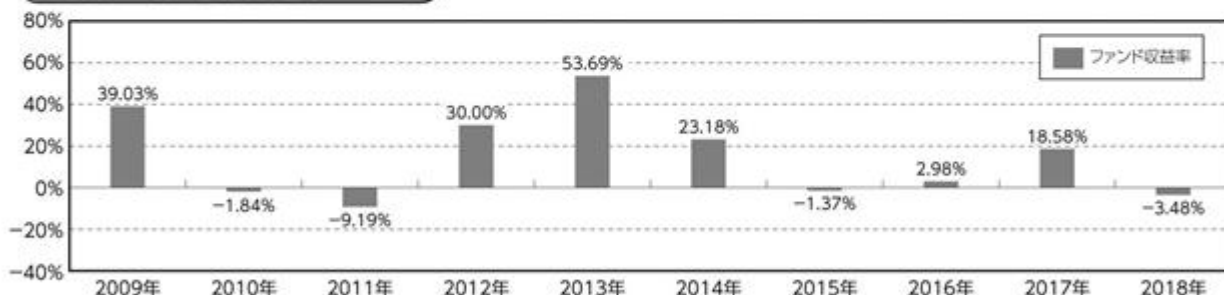
その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.13

株式組入上位5業種

順位	業種	比率
1	銀行	9.89%
2	石油・ガス・消耗燃料	5.88%
3	医薬品	5.18%
4	ソフトウェア	4.32%
5	保険	4.06%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

- 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
- 委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度による取得のみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
なお、ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所の休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）は、お申込みの受付を行いません。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

お申込価額（発行価格）

- ・お申込日の翌営業日の基準価額 とします。
収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。
「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たり換算した基準価額で表示することがあります。）

- ・基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

お申込手数料

ありません。

払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(2)【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成14年9月5日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年2月16日から翌年2月15日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.~f.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この

信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- j. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記 d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は上記a.のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定にしたがいます。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

八. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3カ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、累積投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(平成29年2月16日から平成30年2月15日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 平成29年2月15日現在	第16期 平成30年2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	295,967,411	631,400,085
親投資信託受益証券	107,763,638,596	123,689,689,030
未収入金	30,985,000	96,253,000
流動資産合計	108,090,591,007	124,417,342,115
負債の部		
流動負債		
未払解約金	192,021,381	552,548,024
未払受託者報酬	15,780,933	20,206,851
未払委託者報酬	115,727,227	148,183,858
その他未払費用	1,838,216	2,163,700
流動負債合計	325,367,757	723,102,433
負債合計		
	325,367,757	723,102,433
純資産の部		
元本等		
元本	1 35,378,022,044	1 37,011,356,752
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	72,387,201,206	86,682,882,930
(分配準備積立金)	32,089,385,850	35,769,989,192
元本等合計	107,765,223,250	123,694,239,682
純資産合計		
	107,765,223,250	123,694,239,682
負債純資産合計		
	108,090,591,007	124,417,342,115

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期		第16期	
	自	平成28年2月16日 平成29年2月15日	自	平成29年2月16日 平成30年2月15日
営業収益				
受取利息		608		195
有価証券売買等損益		22,517,234,260		10,712,931,434
営業収益合計		22,517,234,868		10,712,931,629
営業費用				
支払利息		164,457		233,087
受託者報酬		30,058,745		37,976,775
委託者報酬		220,431,437		278,496,890
その他費用		3,671,751		4,151,609
営業費用合計		254,326,390		320,858,361
営業利益又は営業損失()		22,262,908,478		10,392,073,268
経常利益又は経常損失()		22,262,908,478		10,392,073,268
当期純利益又は当期純損失()		22,262,908,478		10,392,073,268
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		1,619,486,784		1,232,849,631
期首剰余金又は期首欠損金()		48,136,926,689		72,387,201,206
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,131,502,454		19,011,969,219
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,131,502,454		19,011,969,219
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,524,649,631		13,875,511,132
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,524,649,631		13,875,511,132
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		72,387,201,206		86,682,882,930

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第15期 平成29年2月15日現在	第16期 平成30年2月15日現在
1. 1 期首元本額	34,077,077,168円	35,378,022,044円
期中追加設定元本額	7,253,514,984円	8,373,163,615円
期中一部解約元本額	5,952,570,108円	6,739,828,907円
2. 受益権の総数	35,378,022,044口	37,011,356,752口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期 自 平成28年2月16日 至 平成29年2月15日	第16期 自 平成29年2月16日 至 平成30年2月15日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(6,293,425,928円)、信託約款に規定される収益調整金(50,280,001,115円)及び分配準備積立金(25,795,959,922円)より分配対象収益は82,369,386,965円(1万口当たり23,282.64円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(9,159,310,141円)、信託約款に規定される収益調整金(59,561,539,427円)及び分配準備積立金(26,610,679,051円)より分配対象収益は95,331,528,619円(1万口当たり25,757.37円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第15期 自 平成28年2月16日 至 平成29年2月15日	第16期 自 平成29年2月16日 至 平成30年2月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期 平成29年2月15日現在	第16期 平成30年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第15期 平成29年2月15日現在	第16期 平成30年2月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	22,015,356,954	10,415,629,822
合計	22,015,356,954	10,415,629,822

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第15期 平成29年2月15日現在	第16期 平成30年2月15日現在
1口当たり純資産額	3.0461円	3.3421円
(1万口当たり純資産額)	(30,461円)	(33,421円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年2月15日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	37,141,820,020	123,689,689,030	
親投資信託受益証券	合計	37,141,820,020	123,689,689,030	
合計		37,141,820,020	123,689,689,030	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成29年2月15日現在	平成30年2月15日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,058,836,544	3,825,958,557
コール・ローン		188,182,919	901,765,949
株式		266,797,454,166	272,128,639,179
投資信託受益証券		842,124,628	721,135,816
投資証券		6,299,075,376	5,648,480,066
派生商品評価勘定		102,112,234	30,144,318
未収入金		70,725,279	26,698,329
未収配当金		366,259,251	325,468,315
差入委託証拠金		1,439,130,139	1,987,831,713
流動資産合計		279,163,900,536	285,596,122,242
資産合計		279,163,900,536	285,596,122,242
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		172,373	161,520,429
未払金		-	8,570,817
未払解約金		200,513,000	977,898,000
流動負債合計		200,685,373	1,147,989,246
負債合計		200,685,373	1,147,989,246
純資産の部			
元本等			
元本	1	92,157,246,137	85,414,197,806
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		186,805,969,026	199,033,935,190
元本等合計		278,963,215,163	284,448,132,996
純資産合計		278,963,215,163	284,448,132,996
負債純資産合計		279,163,900,536	285,596,122,242

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成29年2月15日現在	平成30年2月15日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	101,509,653,233円	92,157,246,137円
	同期中追加設定元本額	17,510,993,765円	19,792,184,569円
	同期中一部解約元本額	26,863,400,861円	26,535,232,900円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,955,790,702円	1,840,400,842円
	MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,454,364円	3,104,022円
	MITO ラップ型ファンド(中立型)	12,188,398円	7,276,226円
	MITO ラップ型ファンド(積極型)	27,615,401円	19,381,505円
	グローバル8資産ラップファンド(安定型)	13,284,546円	15,460,782円
	グローバル8資産ラップファンド(中立型)	12,182,802円	11,993,292円
	グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,970,640円	13,629,779円
	たわらノーロード 先進国株式	2,329,512,262円	5,750,450,189円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	425,695円	424,744円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	77,341,070円	521,036,149円
	たわらノーロード バランス(8資産均等型)	-円	10,313,910円
	たわらノーロード バランス(堅実型)	-円	304,310円
	たわらノーロード バランス(標準型)	-円	3,836,957円
	たわらノーロード バランス(積極型)	-円	10,061,976円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	-円	14,227円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	-円	473,016円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	-円	1,050,304円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	-円	1,017,242円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	-円	2,185,065円
	たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	-円	6,182円
	たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	-円	33,486円
	たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	-円	312,197円
	たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	-円	316,613円
	たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	-円	1,046,842円
	DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	35,600,805,615円	37,141,820,020円

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	171,577,057円	155,272,827円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	934,670,835円	854,160,900円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,091,729,332円	1,042,632,432円
D I A M D C バランス30インデッ クスファンド	151,517,144円	128,651,065円
D I A M D C バランス50インデッ クスファンド	421,997,494円	385,326,790円
D I A M D C バランス70インデッ クスファンド	341,784,827円	330,441,705円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配 型>	42,243,439円	32,623,606円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	936,032,307円	811,105,505円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	215,631,374円	186,981,108円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	27,161,685円	30,483,954円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	53,065,944円	76,050,865円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	105,787,920円	149,320,860円
投資のソムリエ	1,447,959,597円	525,467,955円
クルーズコントロール	423,103,664円	81,781,664円
投資のソムリエ< D C 年金>	43,970,681円	36,100,432円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	88,624,580円	115,601,513円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	44,769,932円	76,218,862円
クルーズコントロール< D C 年金>	156,043円	30,467円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実 型)	2,581,654円	402,135円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極 型)	8,454,381円	1,245,127円
投資のソムリエ< D C 年金>リスク抑制 型	6,618,219円	17,872,394円
ダイナミック・ナビゲーション	1,599,496円	624,194円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	27,290,853円	271,612,111円
ワールドアセットバランス(基本コー ス)	98,442,845円	621,453,988円
ワールドアセットバランス(リスク抑制 コース)	126,050,142円	2,129,164,124円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 045)	- 円	646,857円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 055)	- 円	539,416円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	- 円	83,122円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 035)	- 円	1,105,218円
D I A M外国株式インデックスファンド V A(適格機関投資家専用)	165,756,414円	94,680,639円

D I A M外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	3,211,288,652円	2,951,910,645円
D I A Mアクティブアロケーション私募 ファンド(適格機関投資家限定)	181,837,365円	- 円
D I A M先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	392,000円	161,173,877円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機 関投資家限定)	- 円	208,770,312円
D I A Mワールドバランス25VA(適 格機関投資家限定)	28,887,946円	23,652,082円
D I A Mグローバル・バランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	164,338,818円	104,000,380円
D I A Mグローバル・バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	303,597,413円	229,337,941円
D I A M国際分散バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	21,198,047円	12,671,338円
D I A M国際分散バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	139,441,873円	82,511,736円
D I A M国内重視バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	11,414,013円	7,737,512円
D I A M国内重視バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	16,996,245円	12,881,312円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	763,291,823円	24,714,283円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	507,266,429円	67,799,257円
D I A Mバランスファンド25VA(適 格機関投資家限定)	758,820,305円	559,209,316円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	879,199,320円	694,323,847円
D I A Mバランスファンド50VA(適 格機関投資家限定)	2,714,712,137円	2,176,759,188円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA(適格機関投資家限定)	1,077,050,313円	788,664,451円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA2(適格機関投資家限定)	1,058,494,372円	228,926,672円
D I A M アクサ グローバル バラン スファンド30VA(適格機関投資家限 定)	1,239,985,917円	931,210,759円
D I A M世界アセットバランスファンド VA(適格機関投資家向け)	802,308,599円	438,615,672円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適 格機関投資家向け)	3,672,039円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,674,916,629円	135,785,141円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	1,507,107,240円	366,032,274円
D I A M世界アセットバランスファンド 2VA(適格機関投資家限定)	9,570,173,378円	7,841,422,538円
D I A M世界アセットバランスファンド 40VA(適格機関投資家限定)	523,203,212円	423,028,871円
D I A M世界アセットバランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	1,634,980,661円	1,347,116,256円

D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A (適格機関投資家限定)	6,063,470,656円	5,122,879,137円
D I A Mバランス30 V A (適格機関投 資家限定)	26,291,607円	2,032,372円
D I A Mバランス50 V A (適格機関投 資家限定)	1,003,460円	28,378,177円
D I A Mバランス70 V A (適格機関投 資家限定)	13,078,140円	10,651,080円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	8,144,876,243円	6,836,511,901円
D I A Mバランス20 V A (適格機関投 資家限定)	84,358,582円	42,301,326円
D I A Mバランス40 V A (適格機関投 資家限定)	169,337円	36,544,094円
D I A Mバランス60 V A (適格機関投 資家限定)	274,012円	257,372円
計	92,157,246,137円	85,414,197,806円
2 . 受益権の総数	92,157,246,137口	85,414,197,806口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年2月16日 至 平成29年2月15日	自 平成29年2月16日 至 平成30年2月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年2月15日現在	平成30年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年2月15日現在	平成30年2月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	51,654,624,304	27,656,662,153
投資信託受益証券	48,865,717	31,266,721
投資証券	615,856,683	231,031,548
合計	52,319,346,704	27,394,363,884

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年2月15日 現在				平成30年2月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	159,553,767	-	159,722,100	168,333	105,425,713	-	104,561,840	863,873
アメリカ・ドル	108,647,565	-	108,765,500	117,935	92,417,166	-	91,570,450	846,716
イギリス・ポンド	11,404,000	-	11,406,400	2,400	6,141,554	-	6,136,470	5,084
オーストラリア・ドル	5,253,830	-	5,260,200	6,370	509,124	-	507,840	1,284
カナダ・ドル	5,241,160	-	5,245,200	4,040	2,228,018	-	2,222,220	5,798
ユーロ	29,007,212	-	29,044,800	37,588	4,129,851	-	4,124,860	4,991
買 建	-	-	-	-	357,468,055	-	357,416,180	51,875
アメリカ・ドル	-	-	-	-	259,191,414	-	259,145,320	46,094
イギリス・ポンド	-	-	-	-	21,702,585	-	21,700,700	1,885
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	3,131,347	-	3,130,940	407
カナダ・ドル	-	-	-	-	10,769,094	-	10,767,960	1,134
ユーロ	-	-	-	-	62,673,615	-	62,671,260	2,355
合計	159,553,767	-	159,722,100	168,333	462,893,768	-	461,978,020	811,998

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
 - 2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 - 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成29年2月15日 現在				平成30年2月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	4,662,779,628	-	4,764,887,822	102,108,194	6,272,840,960	-	6,140,652,851	132,188,109
合計	4,662,779,628	-	4,764,887,822	102,108,194	6,272,840,960	-	6,140,652,851	132,188,109

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

- 2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年2月15日現在	平成30年2月15日現在
1口当たり純資産額	3.0270円	3.3302円
(1万口当たり純資産額)	(30,270円)	(33,302円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年2月15日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	28,829	1,451.050	41,832,320.450	
	ABBOTT LABORATORIES	122,602	58.280	7,145,244.560	
	AES CORP	45,579	10.270	468,096.330	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,373	154.760	9,652,845.480	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	12.200	726,253.800	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,138	197.130	6,926,753.940	
	CHUBB LTD	32,773	147.290	4,827,135.170	
	AGCO CORP	5,610	68.610	384,902.100	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,019	161.270	2,422,114.130	
	ALLEGHANY CORP	1,054	588.090	619,846.860	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	106.680	373,059.960	
	ALLSTATE CORP	25,754	95.030	2,447,402.620	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	51,441	150.380	7,735,697.580	
	AMGEN INC	51,512	179.520	9,247,434.240	
	HESS CORP	20,421	45.370	926,500.770	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	96.230	5,156,099.630	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	65.300	2,276,292.700	
	AFLAC INC	28,218	87.650	2,473,307.700	
	AMERICAN INTL GROUP	63,448	59.410	3,769,445.680	
	AMERCO	551	355.500	195,880.500	
	ANALOG DEVICES	25,869	85.130	2,202,227.970	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	38,791	59.780	2,318,925.980	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	123.200	1,973,048.000	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	64,578	37.510	2,422,320.780	
	TIME WARNER	54,567	94.520	5,157,672.840	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	159.660	449,921.880	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	92.630	2,973,886.150	
	APACHE CORP	25,025	38.200	955,955.000	
	ANSYS INC	5,619	157.700	886,116.300	
	APPLE INC	364,593	167.370	61,021,930.410	
	APPLIED MATERIALS INC	75,304	51.960	3,912,795.840	
	ALBEMARLE CORP	7,904	111.720	883,034.880	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	38,303	41.820	1,601,831.460		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	76.090	595,860.790		
AMEREN CORP	17,312	54.680	946,620.160		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	80.190	461,573.640	
AUTOLIV INC	6,197	145.150	899,494.550	
AUTODESK INC	14,259	109.920	1,567,349.280	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,205	112.710	3,517,115.550	
AUTOZONE INC	2,015	720.840	1,452,492.600	
AVERY DENNISON CORP	6,262	118.120	739,667.440	
AVNET INC	10,288	41.900	431,067.200	
BALL CORP	24,324	38.120	927,230.880	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	89,717	200.540	17,991,847.180	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	55.980	4,128,469.020	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	66.030	2,302,862.280	
BECTON DICKINSON & CO	18,586	219.950	4,087,990.700	
AMETEK INC	16,775	74.710	1,253,260.250	
VERIZON COMM INC	287,466	49.510	14,232,441.660	
WR BERKLEY CORP	8,134	69.430	564,743.620	
BEST BUY CO INC	19,210	72.520	1,393,109.200	
YUM! BRANDS INC	23,738	77.880	1,848,715.440	
FIRSTENERGY CORP	30,796	31.950	983,932.200	
H&R BLOCK INC	16,114	26.940	434,111.160	
BOEING CO	39,546	344.850	13,637,438.100	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	56.120	457,826.960	
BORGWARNER INC	14,648	53.490	783,521.520	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,541	26.810	2,615,074.210	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	92.430	914,502.420	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,233	106.560	770,748.480	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	624.670	1,148,143.460	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,634	65.350	7,622,031.900	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	189.450	717,636.600	
INGREDION INC	5,305	129.990	689,596.950	
ONEOK INC	26,177	57.470	1,504,392.190	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,418	110.610	488,674.980	
UNITED RENTALS INC	6,332	167.040	1,057,697.280	
SEMPRA ENERGY	16,912	105.470	1,783,708.640	
FEDEX CORP	18,103	240.820	4,359,564.460	
VERISIGN INC	6,321	113.980	720,467.580	
AMPHENOL CORP	21,490	87.340	1,876,936.600	
BROWN-FORMAN CORP	13,612	67.340	916,632.080	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.090	773,990.280	
CSX CORP	63,992	55.150	3,529,158.800	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	24.000	774,264.000	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	46.960	659,788.000	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	51.370	1,058,889.810	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	214.000	2,619,360.000	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	67.340	1,489,897.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	69.920	1,742,126.720	
CATERPILLAR INC	42,278	158.060	6,682,460.680	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	101.200	994,998.400	
CELGENE CORP	54,731	94.390	5,166,059.090	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	89.440	974,538.240	
CENTURYLINK INC	63,680	17.580	1,119,494.400	
CERNER CORP	20,809	62.220	1,294,735.980	
JPMORGAN CHASE & CO	248,945	115.030	28,636,143.350	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	48.880	920,019.360	
CIGNA CORP	17,595	195.550	3,440,702.250	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	75.570	829,909.740	
CINTAS CORP	6,282	164.360	1,032,509.520	
CISCO SYSTEMS INC	354,512	42.090	14,921,410.080	
CLOROX COMPANY	9,331	128.800	1,201,832.800	
COCA-COLA CO/THE	286,256	44.100	12,623,889.600	
COGNEX CORP	11,508	58.050	668,039.400	
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,819	69.620	4,164,598.780	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,436	145.240	3,258,604.640	
COMERICA INC	12,068	97.400	1,175,423.200	
COMCAST CORP-CL A	333,255	39.430	13,140,244.650	
CA INC	22,732	34.750	789,937.000	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	35.540	1,006,599.420	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	75.890	1,650,607.500	
CMS ENERGY CORP	19,291	42.900	827,583.900	
COOPER COS INC	3,794	229.790	871,823.260	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	80.450	1,114,634.750	
CORNING INC	65,641	29.520	1,937,722.320	
WR GRACE & CO	3,314	66.000	218,724.000	
SEALED AIR CORP	13,870	42.510	589,613.700	
CUMMINS INC	11,239	166.000	1,865,674.000	
DR HORTON INC	24,498	45.420	1,112,699.160	
DANAHER CORP	44,524	96.100	4,278,756.400	
MOODY'S CORP	11,822	163.550	1,933,488.100	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	41,589	79.820	3,319,633.980	
TARGET CORP	37,486	75.350	2,824,570.100	
DEERE & CO	19,364	163.280	3,161,753.920	
MORGAN STANLEY	96,261	55.050	5,299,168.050	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	64.520	1,121,035.000	
COSTAR GROUP INC	2,278	345.630	787,345.140	
THE WALT DISNEY CO	108,774	104.600	11,377,760.400	
DOLLAR TREE INC	17,493	105.870	1,851,983.910	

DOVER CORP	10,736	99.690	1,070,271.840	
OMNICOM GROUP	16,993	82.780	1,406,680.540	
DTE ENERGY CO	13,122	101.230	1,328,340.060	
DUKE ENERGY CORP	49,292	75.480	3,720,560.160	
FLOWSERVE CORP	8,406	42.190	354,649.140	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	95.610	902,175.960	
EBAY INC	70,731	42.440	3,001,823.640	
BANK OF AMERICA CORP	708,728	32.000	22,679,296.000	
CITIGROUP INC	193,450	76.710	14,839,549.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	99.700	1,016,242.100	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	51.530	965,672.200	
EATON CORP PLC	32,234	82.670	2,664,784.780	
EATON VANCE CORP	9,184	55.390	508,701.760	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	38.630	806,478.510	
DISH NETWORK CORP	16,150	44.930	725,619.500	
ECOLAB INC	19,009	129.800	2,467,368.200	
ELECTRONIC ARTS INC	21,766	123.770	2,693,977.820	
SALESFORCE.COM INC	48,240	109.020	5,259,124.800	
EMERSON ELECTRIC CO	45,625	71.310	3,253,518.750	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	80.240	659,653.040	
ENERGY CORP	12,199	73.980	902,482.020	
EOG RESOURCES INC	39,963	106.760	4,266,449.880	
EQUIFAX INC	8,495	114.050	968,854.750	
EQT CORP	17,149	48.510	831,897.990	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	139.730	2,254,403.820	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	63.670	799,058.500	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	38,911	74.930	2,915,601.230	
EXXON MOBIL CORP	298,736	76.460	22,841,354.560	
FMC CORP	8,970	85.260	764,782.200	
NEXTERA ENERGY INC	33,513	150.080	5,029,631.040	
ASSURANT INC	4,089	89.640	366,537.960	
FASTENAL CO	21,654	54.650	1,183,391.100	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	33.250	1,734,752.250	
M&T BANK CORP	9,799	191.980	1,881,212.020	
FISERV INC	14,095	138.400	1,950,748.000	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	49.070	570,340.610	
MACY'S INC	19,266	25.640	493,980.240	
FORD MOTOR CO	261,895	10.740	2,812,752.300	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	39.810	888,320.340	
FREEMONT-MCMORAN INC	96,812	19.120	1,851,045.440	
FLEX LTD	35,913	17.080	613,394.040	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	68.200	830,403.200	
GAP INC/THE	18,295	33.110	605,747.450	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	57.180	999,334.860	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,942	218.250	3,915,841.500	
GENERAL MILLS INC	38,727	56.030	2,169,873.810	
GENUINE PARTS CO	9,785	98.950	968,225.750	
GILEAD SCIENCES INC	91,960	81.820	7,524,167.200	

GARTNER INC	7,153	120.460	861,650.380	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	29.580	535,309.260	
MCKESSON CORP	15,054	148.770	2,239,583.580	
NVIDIA CORP	42,645	241.420	10,295,355.900	
GENERAL ELECTRIC CO	608,018	14.900	9,059,468.200	
WW GRAINGER INC	3,832	264.740	1,014,483.680	
HALLIBURTON CO	61,528	47.870	2,945,345.360	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	63.900	1,886,455.800	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,381	262.580	6,664,542.980	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	47.940	618,473.940	
HARRIS CORP	8,954	154.970	1,387,601.380	
HASBRO INC	7,736	96.710	748,148.560	
HENRY SCHEIN INC	11,426	68.430	781,881.180	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	66.120	476,923.560	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	99.020	1,003,270.640	
HP INC	122,725	21.290	2,612,815.250	
F5 NETWORKS INC	4,874	143.500	699,419.000	
CROWN HOLDINGS INC NPR	7,781	50.650	394,107.650	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	136.920	471,963.240	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.170	725,955.800	
HOLLYFRONTIER CORP	11,051	46.780	516,965.780	
HOLOGIC INC	19,133	38.030	727,627.990	
UNUM GROUP	16,000	52.450	839,200.000	
HOME DEPOT INC	83,442	184.690	15,410,902.980	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	84.540	1,089,466.980	
HORMEL FOODS CORP	19,345	34.040	658,503.800	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	26.190	836,822.880	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	203.730	476,117.010	
HUMANA INC	10,468	267.470	2,799,875.960	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	120.000	711,240.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	15.890	1,194,308.290	
RED HAT INC	12,098	134.190	1,623,430.620	
BIOGEN INC	14,861	296.080	4,400,044.880	
IDEX CORP	4,699	135.040	634,552.960	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,032	162.470	3,579,539.040	
INTUIT INC	16,934	163.900	2,775,482.600	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	178.260	1,115,016.300	
INGERSOLL-RAND PLC	16,730	90.390	1,512,224.700	
INTEL CORP	331,236	45.380	15,031,489.680	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	144.850	807,973.300	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	58.380	1,656,532.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	24.490	714,054.930	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	63.660	504,887.460	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,173	119.280	497,755.440	
INCYTE CORP	12,360	88.170	1,089,781.200	
JOHNSON & JOHNSON	189,511	129.670	24,573,891.370	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	54.530	1,392,150.900	
KLA-TENCOR CORP	11,724	107.470	1,259,978.280	
DEVON ENERGY CORP	34,184	35.560	1,215,583.040	
WESTAR ENERGY INC	9,911	49.810	493,666.910	
KELLOGG CO	18,922	67.740	1,281,776.280	
EAST WEST BANCORP INC	8,509	66.950	569,677.550	
KEYCORP	71,550	21.170	1,514,713.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	24,202	112.730	2,728,291.460	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,616	539.940	4,652,123.040	
KOHL'S CORP	11,357	64.570	733,321.490	
KROGER CO	62,093	28.400	1,763,441.200	
LAM RESEARCH CORP	11,522	183.010	2,108,641.220	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	115.990	714,150.430	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	66.870	844,033.140	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	44.930	430,788.840	
LENNAR CORP	16,200	61.230	991,926.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	25.220	541,271.640	
ELI LILLY & CO	70,283	77.030	5,413,899.490	
L BRANDS INC	16,262	49.870	810,985.940	
LINCOLN NATIONAL CORP	14,163	77.300	1,094,799.900	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,982	106.600	5,114,881.200	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	22,357	69.700	1,558,282.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,240	354.660	6,468,998.400	
LOEWS CORP	21,346	48.870	1,043,179.020	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	13.140	179,978.580	
LOWE'S COS INC	58,178	96.930	5,639,193.540	
DOMINION ENERGY INC	45,131	74.340	3,355,038.540	
SCANA CORP	10,902	36.480	397,704.960	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	34.440	1,108,899.120	
MCCORMICK & CO INC	7,476	103.760	775,709.760	
MCDONALD'S CORPORATION	57,515	159.990	9,201,824.850	
S&P GLOBAL INC	18,409	186.030	3,424,626.270	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	242.590	692,594.450	
MANPOWERGROUP INC	4,257	122.970	523,483.290	
MARKEL CORPORATION	989	1,115.010	1,102,744.890	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	14,774	130.210	1,923,722.540	
MARSH & MCLENNAN COS	35,821	82.260	2,946,635.460	
MASCO CORP	23,043	42.940	989,466.420	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	215.700	946,275.900	
MATTEL INC	24,003	16.510	396,289.530	
METLIFE INC	64,937	46.700	3,032,557.900	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	59.140	1,203,025.880	
MEDTRONIC PLC	95,177	81.860	7,791,189.220	
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,052	69.650	3,486,121.800	
CVS HEALTH CORP	71,913	69.790	5,018,808.270	
MERCK & CO. INC.	193,111	54.900	10,601,793.900	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	172.690	1,239,223.440	
MICROSOFT CORP	516,674	90.810	46,919,165.940	
MICRON TECH INC	76,146	43.450	3,308,543.700	
MIDDLEBY CORP	4,100	133.460	547,186.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,331	82.210	1,260,361.510	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	22.260	589,066.380	
3M CO	42,407	232.000	9,838,424.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,042	253.500	1,024,647.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,582	105.020	1,111,321.640	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	106.380	770,935.860	
MYLAN NV	31,344	41.340	1,295,760.960	
ILLUMINA INC	10,453	223.110	2,332,168.830	
XCEL ENERGY INC	37,554	43.220	1,623,083.880	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	35.140	946,601.320	
NETAPP INC	18,387	60.640	1,114,987.680	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	26.730	367,270.200	
NEWELL BRANDS INC	36,206	27.200	984,803.200	
NEWMONT MINING CORP	38,093	39.000	1,485,627.000	
NVR INC	236	3,060.010	722,162.360	
NIKE INC-CL B	92,505	67.960	6,286,639.800	
NOBLE ENERGY INC	31,005	26.460	820,392.300	
NORDSTROM INC	9,487	50.360	477,765.320	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,973	142.250	2,841,159.250	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	57.580	1,329,234.300	
NISOURCE INC	22,198	22.740	504,782.520	
TAPESTRY INC	19,175	50.490	968,145.750	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	102.690	1,652,282.100	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,569	349.620	4,044,753.780	
WELLS FARGO & CO	332,695	59.550	19,811,987.250	
NUCOR CORP	23,780	65.190	1,550,218.200	
MONSANTO CO	30,856	120.180	3,708,274.080	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	58.180	926,632.860	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,007	97.380	3,214,221.660	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,121	69.850	3,780,351.850	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,814	138.520	528,315.280	
OGE ENERGY CORP	16,028	30.780	493,341.840	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	247.550	1,578,131.250	
ORACLE CORP	218,956	49.450	10,827,374.200	
PACCAR INC	24,457	69.120	1,690,467.840	
EXELON CORP	69,910	36.600	2,558,706.000	
PARKER HANNIFIN CORP	8,808	183.890	1,619,703.120	
PAYCHEX INC	23,141	65.370	1,512,727.170	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	50.390	328,845.140	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	246.340	1,294,516.700	
PPL CORPORATION	45,666	30.270	1,382,309.820	
PEPSICO INC	100,305	109.110	10,944,278.550	
PENTAIR PLC	11,775	70.810	833,787.750	
PFIZER INC	419,744	35.190	14,770,791.360	
CONOCOPHILLIPS	86,115	55.510	4,780,243.650	
PVH CORP	5,387	150.660	811,605.420	
PG&E CORP	34,361	39.080	1,342,827.880	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	179.500	2,182,361.000	
ALTRIA GROUP INC	135,928	65.180	8,859,787.040	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,538	158.270	5,466,329.260	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	117.000	449,865.000	
GARMIN LTD	7,795	64.000	498,880.000	
AETNA INC	23,744	176.770	4,197,226.880	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	57.370	563,430.770	
PPG INDUSTRIES INC	17,674	116.320	2,055,839.680	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	252.460	616,254.860	
PRAXAIR INC	20,519	155.070	3,181,881.330	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,869	187.350	5,783,307.150	
T ROWE PRICE GROUP INC	16,303	108.320	1,765,940.960	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	101.510	1,053,470.780	
PROCTER & GAMBLE CO	179,972	80.680	14,520,140.960	
PROGRESSIVE CORP	41,336	56.300	2,327,216.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	47.620	1,767,416.300	
PULTE GROUP INC	21,209	29.460	624,817.140	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	13.850	420,873.800	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	107.580	1,158,529.020	
QUALCOMM INC	104,228	66.590	6,940,542.520	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	91.020	927,220.740	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	129.590	330,454.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	330.690	1,871,374.710	

REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	153.980	714,775.160	
AUTONATION INC	5,772	52.730	304,357.560	
RESMED INC	9,394	93.470	878,057.180	
US BANCORP	118,641	55.310	6,562,033.710	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	54.060	395,557.020	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	90.040	781,006.960	
ROSS STORES INC	28,189	78.930	2,224,957.770	
ROLLINS INC	5,357	48.200	258,207.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,983	271.090	1,893,021.470	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	187.090	1,658,927.030	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	130.530	1,604,605.290	
RAYTHEON COMPANY	20,463	212.580	4,350,024.540	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	250.050	962,192.400	
ACCENTURE PLC-CL A	43,740	159.790	6,989,214.600	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	106,478	42.960	4,574,294.880	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	159.250	1,409,203.250	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	134.440	1,624,841.840	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	140.600	2,777,553.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,718	96.000	2,180,928.000	
PRICELINE GROUP INC	3,460	1,818.410	6,291,698.600	
SCHLUMBERGER LTD	98,476	65.870	6,486,614.120	
SCHWAB (CHARLES) CORP	83,988	52.400	4,400,971.200	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	117.700	1,668,397.500	
BUNGE LTD	10,334	75.060	775,670.040	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	72.980	679,808.700	
ANTHEM INC	18,448	235.020	4,335,648.960	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	96.400	1,181,574.800	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	63.270	1,356,635.340	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	405.660	2,416,922.280	
CENTENE CORP	12,713	102.130	1,298,378.690	
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	247.490	858,295.320	
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	149.740	756,187.000	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	64.060	612,733.900	
ACUITY BRANDS INC	3,087	151.670	468,205.290	
SNAP-ON INC	3,932	159.030	625,305.960	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,203	111.270	3,360,687.810	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	109.020	574,862.460	
EDISON INTERNATIONAL	21,963	59.240	1,301,088.120	
SOUTHERN CO	70,353	43.580	3,065,983.740	
BB&T CORP	55,828	54.740	3,056,024.720	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	57.730	655,350.960	

AT&T INC	432,405	36.410	15,743,866.050	
CHEVRON CORP	133,469	113.630	15,166,082.470	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,528	159.270	1,676,794.560	
STATE STREET CORP	27,099	103.940	2,816,670.060	
STARBUCKS CORP	101,469	55.990	5,681,249.310	
STEEL DYNAMICS INC	15,309	46.790	716,308.110	
STRYKER CORP	24,140	156.240	3,771,633.600	
NETFLIX INC	30,587	266.000	8,136,142.000	
STERICYCLE INC	6,853	74.290	509,109.370	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	70.070	2,435,352.920	
SYMANTEC CORP	41,694	27.020	1,126,571.880	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	48.670	476,625.310	
SYNOPSIS INC	10,656	86.620	923,022.720	
SYSCO CORP	35,926	58.350	2,096,282.100	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,788	409.890	3,192,223.320	
TELEFLEX INC	3,203	260.960	835,854.880	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	19.330	1,234,278.490	
ANDEAVOR	11,500	98.610	1,134,015.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	69,626	102.680	7,149,197.680	
TEXTRON INC	19,076	58.800	1,121,668.800	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,065	208.310	5,846,220.150	
TIFFANY & CO	8,733	103.110	900,459.630	
TOLL BROTHERS INC	9,526	46.490	442,863.740	
TORCHMARK CORP	7,699	86.300	664,423.700	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	84.620	954,428.980	
DAVITA INC	10,878	74.750	813,130.500	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	68.000	630,768.000	
TRIMBLE INC	20,073	40.010	803,120.730	
TYSON FOODS INC	21,621	75.840	1,639,736.640	
UGI CORP	12,068	43.250	521,941.000	
MARATHON OIL CORP	58,747	16.950	995,761.650	
UNION PACIFIC CORP	56,617	133.190	7,540,818.230	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	53,690	126.700	6,802,523.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,378	228.780	15,643,518.840	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	116.850	742,114.350	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	119.530	818,541.440	
VF CORP	24,309	83.690	2,034,420.210	
CBS CORP	23,781	55.850	1,328,168.850	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	157.260	2,790,106.920	
VULCAN MATERIALS CO	8,964	129.620	1,161,913.680	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	68.490	4,334,458.140	
WALMART INC	106,126	101.700	10,793,014.200	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	82.600	2,661,041.600	
WATERS CORP	5,963	204.620	1,220,149.060	
ALLERGAN PLC	23,313	166.630	3,884,645.190	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	7,671	121.010	928,267.710	
VAIL RESORTS INC	2,598	212.290	551,529.420	
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	83.330	1,709,598.280	
WABTEC CORP	5,497	73.200	402,380.400	
WHIRLPOOL CORP	5,553	171.210	950,729.130	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	104.650	1,415,809.850	
WYNN RESORTS LTD	6,279	164.160	1,030,760.640	
NASDAQ INC	9,132	79.760	728,368.320	
CME GROUP INC	24,203	162.150	3,924,516.450	
WILLIAMS COS INC	61,081	29.980	1,831,208.380	
LKQ CORP	22,948	41.440	950,965.120	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	38.110	624,356.130	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	60.140	1,390,256.380	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	56.450	1,051,719.950	
CARMAX INC	13,513	63.780	861,859.140	
XEROX CORP	17,455	29.790	519,984.450	
XILINX INC	16,837	66.860	1,125,721.820	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	102.190	715,636.570	
TJX COMPANIES INC	43,999	76.570	3,369,003.430	
ZIONS BANCORP	16,584	54.510	903,993.840	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.860	524,104.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	61.670	968,219.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	38.350	655,785.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	119.980	725,998.980	
SIGNATURE BANK	4,171	153.000	638,163.000	
CBRE GROUP INC	20,976	45.040	944,759.040	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	36.490	453,753.150	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	19.370	1,636,493.820	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	209.780	683,043.680	
T-MOBILE US INC	21,188	58.620	1,242,040.560	
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	74.450	2,113,412.150	
MOSAIC CO/THE	26,525	25.720	682,223.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	27,332	36.180	988,871.760	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	36.550	2,753,677.000	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	64.050	350,545.650	

CELANESE CORP	9,491	102.780	975,484.980	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	23.830	248,380.090	
EXPEDIA INC	8,709	100.100	871,770.900	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	39.660	732,718.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	160.550	1,698,297.900	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	34.920	1,460,284.560	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	71.070	2,990,980.950	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	17.760	261,000.960	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	33.930	835,085.160	
LIVE NATION	8,864	45.310	401,627.840	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	289.910	523,867.370	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	65.680	406,624.880	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	290.390	1,106,966.680	
MASTERCARD INC	67,015	172.520	11,561,427.800	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	27.970	825,982.070	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	121.670	904,738.120	
HANESBRANDS INC	27,619	21.140	583,865.660	
WESTERN UNION CO	35,222	20.300	715,006.600	
OWENS CORNING	7,333	86.320	632,984.560	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	65.730	612,735.060	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.670	610,234.620	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,576	92.090	697,673.840	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	28.080	508,219.920	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	97.340	810,842.200	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	19.580	445,366.680	
DELTA AIR LINES INC	9,473	52.200	494,490.600	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	53.700	341,209.800	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	77.610	2,109,206.970	
TE CONNECTIVITY LTD	24,311	99.740	2,424,779.140	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	146.860	1,549,666.720	
WABCO HOLDING INC	3,176	143.220	454,866.720	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	81.220	542,793.260	
VMWARE INC	5,491	124.420	683,190.220	
MERCADOLIBRE INC	2,861	375.710	1,074,906.310	
ULTA BEAUTY INC	4,332	206.760	895,684.320	
INVESCO LTD	29,824	33.170	989,262.080	

MSCI INC	6,462	145.650	941,190.300	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	108,948	102.540	11,171,527.920	
VISA INC	130,002	120.830	15,708,141.660	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	114.910	1,444,648.520	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	78.330	939,333.360	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	87.580	576,714.300	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,085	22.680	364,807.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	68.160	2,499,631.680	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	63.160	734,171.840	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	105.530	192,697.780	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	133,961	17.450	2,337,619.450	
XYLEM INC	12,873	73.310	943,719.630	
ALKERMES PLC	12,053	59.290	714,622.370	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,062	112.000	2,582,944.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	241.400	839,830.600	
SPLUNK INC	10,674	92.350	985,743.900	
HCA HEALTHCARE INC	20,173	99.910	2,015,484.430	
VERISK ANALYTICS INC	10,053	96.630	971,421.390	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	145.840	581,464.080	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	194.770	1,274,574.880	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	95.150	1,015,060.200	
CIT GROUP INC	9,287	53.530	497,133.110	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	114.880	2,602,261.760	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	47.810	786,235.450	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.350	141,960.000	
LEAR CORP	5,132	192.160	986,165.120	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,040	115.000	809,600.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	49.760	529,098.080	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	96.670	1,871,047.850	
FORTINET INC	11,399	48.380	551,483.620	
AON PLC	18,487	139.970	2,587,625.390	
TESLA INC	9,357	322.310	3,015,854.670	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	52.880	602,408.960	
GENERAL MOTORS CO	91,138	41.810	3,810,479.780	
WORLDPAY INC	10,448	74.290	776,181.920	

TRIPADVISOR INC	9,263	40.720	377,189.360	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	28.490	894,842.410	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	9,958	63.380	631,138.040	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	51.190	692,344.750	
APTIV PLC	19,069	92.690	1,767,505.610	
PHILLIPS 66	30,976	93.330	2,890,990.080	
FACEBOOK INC	167,584	179.520	30,084,679.680	
IQVIA HOLDINGS INC	10,051	104.680	1,052,138.680	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	122.830	866,442.820	
SERVICENOW INC	12,206	147.740	1,803,314.440	
PALO ALTO NETWORKS INC	6,215	158.370	984,269.550	
TESARO INC	2,646	61.660	163,152.360	
WORKDAY INC	9,187	120.710	1,108,962.770	
ABBVIE INC	112,299	113.080	12,698,770.920	
ZOETIS INC	34,425	74.460	2,563,285.500	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	58.880	719,749.120	
COTY INC	31,440	21.250	668,100.000	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	16.340	494,497.420	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	35.980	463,818.180	
CDW CORP	10,824	70.380	761,793.120	
SPRINT CORP	63,882	5.310	339,213.420	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	51.070	520,862.930	
ARCONIC INC	27,513	25.480	701,031.240	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	37.320	324,385.440	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,175	34.630	456,250.250	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	42.170	211,103.020	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	41.770	558,381.360	
XL GROUP LTD	17,166	43.500	746,721.000	
BROADCOM LTD	28,737	247.660	7,117,005.420	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	69.870	1,053,220.380	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	16.140	248,717.400	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	26.420	750,433.680	
TECHNIPFMC LTD	32,556	30.160	981,888.960	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	55.710	350,471.610	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	18.270	240,488.010	
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	57.900	404,142.000	
TWITTER INC	43,692	33.750	1,474,605.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	22.770	178,448.490	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	38.880	502,329.600	
ALLEGION PLC	5,402	79.970	431,997.940	
PERRIGO CO PLC	8,553	86.660	741,202.980	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	85.970	1,272,012.120	
ARAMARK	17,307	41.150	712,183.050	

SABRE CORP	17,624	21.570	380,149.680	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	23.470	409,645.380	
ARISTA NETWORKS INC	3,158	302.120	954,094.960	
IHS MARKIT LTD	27,511	46.100	1,268,257.100	
FNF GROUP	17,760	38.280	679,852.800	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	36.700	2,109,699.500	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	45.850	1,597,643.250	
CDK GLOBAL INC	8,309	71.620	595,090.580	
QORVO INC	8,784	78.820	692,354.880	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	36.180	412,054.020	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	90.150	704,792.700	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	30.840	453,656.400	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	32.980	885,183.200	
TRANSUNION	10,341	55.820	577,234.620	
SQUARE INC	17,376	41.850	727,185.600	
DOWDUPONT INC	165,219	71.330	11,785,071.270	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	14,000	37.220	521,080.000	
WESTROCK CO	17,744	64.300	1,140,939.200	
KRAFT HEINZ CO	43,818	71.920	3,151,390.560	
FORTIVE CORP	21,682	74.190	1,608,587.580	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	69.380	1,309,825.020	
ALPHABET INC-CL A	20,892	1,072.700	22,410,848.400	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	16.150	1,828,858.300	
PAYPAL HOLDINGS INC	81,079	77.270	6,264,974.330	
FIRST DATA CORP	22,035	15.840	349,034.400	
DXC TECHNOLOGY CO	19,649	100.140	1,967,650.860	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	46.970	382,053.980	
ALPHABET INC-CL C	22,297	1,069.700	23,851,100.900	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	209.000	1,231,428.000	
CHEMOURS CO	12,723	49.010	623,554.230	
ATHENE HOLDING LTD	8,984	48.630	436,891.920	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,583	358.940	4,875,482.020	
VISTRA ENERGY CORP	15,825	18.260	288,964.500	
アメリカ・ドル 小計	21,976,886		1,670,715,750.380 (178,532,685,086)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	9.160	237,289.800	
ASHTED GROUP	35,233	20.050	706,421.650	
SEVERN TRENT PLC	14,897	17.300	257,718.100	
BHP BILLITON PLC	153,323	15.746	2,414,223.950	
BARCLAYS PLC	1,164,260	1.957	2,278,456.820	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.478	354,327.990	
BT GROUP PLC	576,686	2.255	1,300,426.930	
SKY PLC	72,210	10.820	781,312.200	

BUNZL PLC	22,241	20.310	451,714.710	
EASYJET PLC	13,628	16.515	225,066.420	
CAPITA PLC	54,894	1.895	104,024.130	
AVIVA PLC	277,861	4.914	1,365,408.950	
CRODA INTERNATIONAL	8,407	43.250	363,602.750	
DIAGEO PLC	179,703	24.735	4,444,953.700	
SCHRODERS PLC	6,697	33.600	225,019.200	
DCC PLC	5,936	68.000	403,648.000	
NATIONAL GRID PLC	229,884	7.442	1,710,796.720	
GKN PLC	134,180	4.113	551,882.340	
KINGFISHER PLC	165,680	3.590	594,791.200	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.724	1,288,907.420	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	162,930	44.400	7,234,092.000	
COBHAM PLC	142,739	1.191	170,002.140	
NEXT PLC	9,731	48.110	468,158.410	
IMPERIAL BRANDS PLC	65,739	26.240	1,724,991.360	
IMI PLC	21,218	12.360	262,254.480	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	31.040	388,838.080	
ANGLO AMERICAN PLC	93,573	16.934	1,584,565.180	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.485	1,782,493.830	
HSBC HOLDINGS PLC	1,415,041	7.501	10,614,222.540	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.526	1,070,137.370	
CENTRICA PLC	392,766	1.274	500,383.880	
UNILEVER PLC	89,305	37.920	3,386,445.600	
MEGGITT PLC	62,181	4.663	289,950.000	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.170	337,829.940	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,714	6.692	232,306.080	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.032	487,771.640	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	26.140	661,551.120	
PEARSON PLC	65,009	6.676	434,000.080	
PERSIMMON PLC	23,150	24.100	557,915.000	
PRUDENTIAL PLC	182,973	18.130	3,317,300.490	
RIO TINTO PLC	85,976	40.260	3,461,393.760	
VODAFONE GROUP PLC	1,906,594	1.997	3,807,468.210	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,231	63.230	2,986,416.130	
RELX PLC	72,305	14.565	1,053,122.320	
OLD MUTUAL PLC	339,296	2.394	812,274.620	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.206	959,822.990	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	246,107	2.749	676,548.140	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.200	457,900.800	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	13.960	284,183.720	

SSE PLC	73,043	11.910	869,942.130	
BP PLC	1,384,828	4.749	6,576,548.170	
SHIRE PLC	65,457	31.355	2,052,404.230	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.896	588,028.810	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.445	489,915.400	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	8.090	1,921,641.970	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,055,136	0.666	3,366,720.570	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.857	469,861.850	
TESCO PLC	562,988	2.022	1,138,361.730	
3I GROUP PLC	66,784	8.910	595,045.440	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.585	832,560.670	
GLAXOSMITHKLINE PLC	345,537	12.908	4,460,191.590	
WEIR GROUP	18,336	20.230	370,937.280	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	39.720	869,391.360	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.384	135,991.960	
WPP PLC	90,628	13.840	1,254,291.520	
FERGUSON PLC	18,238	51.400	937,433.200	
ASTRAZENECA PLC	88,762	48.300	4,287,204.600	
WHITBREAD PLC	12,159	38.150	463,865.850	
CARNIVAL PLC	13,153	48.530	638,315.090	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.908	349,803.320	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.000	293,928.000	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	48.510	546,853.230	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	15.430	461,248.990	
INVESTEC PLC	50,655	6.028	305,348.340	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	46.400	573,596.800	
ITV PLC	247,210	1.654	408,885.340	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.448	267,835.680	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	63.860	446,892.280	
G4S PLC	122,250	2.520	308,070.000	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	18.835	299,344.650	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	37.880	406,300.880	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	319,445	22.815	7,288,137.670	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	261,972	23.195	6,076,440.540	
TUI AG-DI	30,153	15.400	464,356.200	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	3.893	717,024.410	
EXPERIAN PLC	62,214	15.280	950,629.920	
MONDI PLC	24,061	17.915	431,052.810	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	16.615	353,733.350	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	13.295	207,920.500	
GLENCORE PLC	865,423	3.824	3,309,377.550	

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.857	434,660.750	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	5.720	175,123.520	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	23.440	314,236.640	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.976	233,958.400	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	5.400	297,324.000	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.341	167,173.610	
	WORLDPAY INC	10,775	52.590	566,657.250	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	20.480	662,364.160	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.630	277,143.240	
イギリス・ポンド	小計	21,463,355		129,978,408.340 (19,455,168,160)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPAOALIM BM	78,428	24.710	1,937,955.880	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	21.080	2,172,525.880	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.240	986,325.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	523.000	920,480.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	311.300	809,380.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	14.510	716,953.610	
	NICE LTD	4,035	309.900	1,250,446.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.740	655,256.560	
イスラエル・シュケル	小計	437,969		9,449,323.630 (286,503,492)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	66.430	738,369.450	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	203,883	27.640	5,635,326.120	
	AMCOR LTD	80,741	14.210	1,147,329.610	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	239,994	30.170	7,240,618.980	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	11.920	364,382.480	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	5.100	582,037.500	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.430	936,112.170	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.870	424,082.180	
	AMP LTD	200,498	5.210	1,044,594.580	
	ASX LTD	10,290	54.100	556,689.000	
	BHP BILLITON LTD	232,053	30.020	6,966,231.060	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	33.520	702,109.920	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	4.310	95,604.420	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.290	657,711.600	
	CSL LIMITED	32,212	149.290	4,808,929.480	
	REA GROUP LTD	4,119	75.810	312,261.390	

TRANSURBAN GROUP	149,591	11.580	1,732,263.780	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.250	400,958.250	
COCHLEAR LTD	3,992	175.990	702,552.080	
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	8.310	1,011,501.510	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	121,208	73.980	8,966,967.840	
BORAL LIMITED	86,101	7.370	634,564.370	
RIO TINTO LIMITED	26,822	78.890	2,115,987.580	
APA GROUP	73,253	7.860	575,768.580	
ARISTOCRAT LEISU	37,393	23.580	881,726.940	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	7.500	1,286,032.500	
TPG TELECOM LTD	28,719	5.980	171,739.620	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	49.570	162,341.750	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	22.810	649,834.090	
ORICA LTD	25,308	18.260	462,124.080	
CIMIC GROUP LTD	8,709	44.590	388,334.310	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.690	542,663.290	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.420	546,534.600	
MACQUARIE GROUP LTD	21,627	102.100	2,208,116.700	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.320	1,241,170.920	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	28.900	5,574,289.800	
NEWCREST MINING LTD	51,533	22.300	1,149,185.900	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.360	689,742.400	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.630	495,226.380	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.400	992,056.000	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.300	562,196.100	
SANTOS LTD	133,862	4.880	653,246.560	
SONIC HEALTHCARE	26,192	24.210	634,108.320	
TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.460	563,512.080	
WESFARMERS LTD	81,021	40.540	3,284,591.340	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.230	411,686.990	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,249	31.080	1,872,538.920	
WOOLWORTHS GROUP LTD	91,294	26.740	2,441,201.560	
SEEK LTD	25,899	19.900	515,390.100	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	46.500	213,016.500	
AUSNET SERVICES	165,066	1.575	259,978.950	
AGL ENERGY LTD	46,315	21.780	1,008,740.700	
BRAMBLES LTD	115,255	9.600	1,106,448.000	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.850	422,263.850	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.530	630,503.520	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	17.000	863,413.000	

	HEALTHSCOPE LTD	149,047	1.870	278,717.890	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	3.010	533,299.760	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.700	1,358,110.900	
オーストラリア・ドル 小計		5,316,694		83,407,038.250 (7,060,405,788)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	57.170	922,780.970	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	61.130	1,878,402.640	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	17.140	1,433,726.720	
	ATCO LTD	7,193	42.070	302,609.510	
	BANK OF MONTREAL	45,451	97.210	4,418,291.710	
	BANK OF NOVA SCOTIA	84,484	77.730	6,566,941.320	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	61.720	1,466,220.320	
	BCE INC	11,568	55.630	643,527.840	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	57,500	48.390	2,782,425.000	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	23.000	593,837.000	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.290	498,813.350	
	SAPUTO INC	14,101	40.500	571,090.500	
	BLACKBERRY LTD	39,652	15.120	599,538.240	
	CGI GROUP INC	15,228	72.490	1,103,877.720	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	55.850	633,339.000	
	CAE INC	23,000	23.100	531,300.000	
	CAMECO CORP	32,627	11.620	379,125.740	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	57.130	1,483,494.710	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29,471	115.510	3,404,195.210	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	39.660	3,149,797.200	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	163.750	796,152.500	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	34.260	312,416.940	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	52,687	96.350	5,076,392.450	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.190	219,092.230	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	38.870	541,459.100	
	OPEN TEXT CORP	19,756	44.350	876,178.600	
	EMPIRE CO LTD	15,093	23.260	351,063.180	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	5.360	534,611.760	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	33.200	328,414.400	
	FORTIS INC	29,002	39.690	1,151,089.380	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	21.090	1,166,192.640	
	TELUS CORP	15,945	44.280	706,044.600	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	33.980	654,047.040		
IMPERIAL OIL LTD	21,542	34.690	747,291.980		
ENBRIDGE INC	112,614	42.860	4,826,636.040		
IGM FINANCIAL INC	8,426	39.210	330,383.460		

TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.630	319,421.850	
MANULIFE FINANCIAL CORP	136,517	24.870	3,395,177.790	
LINAMAR CORP	3,827	69.960	267,736.920	
LOBLAW CO LTD	15,354	64.510	990,486.540	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	58.490	381,588.760	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	68.440	1,734,201.160	
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,842	51.670	2,110,306.140	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	629.930	1,250,411.050	
METRO INC	12,389	38.900	481,932.100	
HUSKY ENERGY INC	28,749	16.380	470,908.620	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	8.930	357,128.560	
METHANEX CORP	7,381	71.950	531,062.950	
ONEX CORP	6,646	88.500	588,171.000	
GOLDCORP INC	51,066	16.780	856,887.480	
POWER CORP OF CANADA	25,052	29.900	749,054.800	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	32.790	573,300.360	
ROYAL BANK OF CANADA	103,945	100.510	10,447,511.950	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	52.770	693,081.180	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	227.810	2,416,380.670	
SHAW COMM INC-B	27,548	25.560	704,126.880	
SUNCOR ENERGY INC	116,895	42.520	4,970,375.400	
LUNDIN MINING CORP	35,268	8.690	306,478.920	
ENCANA CORP	69,257	14.010	970,290.570	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	37.960	1,556,967.360	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	50.210	1,027,748.490	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	131,189	72.320	9,487,588.480	
TRANSCANADA CORP	62,895	53.640	3,373,687.800	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	86.360	491,906.560	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	103.610	321,709.050	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	96.850	1,044,527.250	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	24.930	846,198.990	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	815.360	1,218,147.840	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	12,787	92.830	1,187,017.210	
CI FINANCIAL CORP	20,695	27.820	575,734.900	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	18.410	290,491.390	
KEYERA CORP	13,728	32.660	448,356.480	
ALTAGAS LTD	12,538	25.980	325,737.240	
PEMBINA PIPELINE CORP	30,850	40.380	1,245,723.000	
DOLLARAMA INC	7,504	153.210	1,149,687.840	

	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	9.880	795,784.600	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	42.280	350,543.480	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	12.390	284,932.830	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	4.970	152,236.070	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	22.800	549,092.400	
	NUTRIEN LTD	45,351	55.740	2,527,864.740	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	29.080	435,065.880	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	15.950	274,834.450	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	72.210	1,108,640.130	
	SHOPIFY INC	5,021	171.490	861,051.290	
	HYDRO ONE LTD	13,354	20.250	270,418.500	
カナダ・ドル 小計		2,893,366		119,748,516.900 (10,236,103,225)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.270	408,750.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	3.180	258,852.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.640	326,568.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.355	245,709.700	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	124,200	28.030	3,481,326.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	12.360	358,440.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	37.140	220,760.160	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.200	219,960.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.390	509,171.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.530	679,224.950	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.220	508,008.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	7.800	767,520.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.020	359,358.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	12.260	2,764,053.780	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.350	1,982,938.700	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.150	529,625.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	26.240	2,479,680.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.210	332,505.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	2.980	274,160.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.340	252,992.000		
シンガポール・ドル 小計		3,458,374		16,959,602.290 (1,378,306,878)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	167,395	17.115	2,864,965.420	
	NESTLE SA-REGISTERED	219,706	77.320	16,987,667.920	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	84.000	3,144,792.000	

	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	49,663	222.600	11,054,983.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	221.200	627,102.000	
	SIKA INHABER	151	7,560.000	1,141,560.000	
	SGS SA-REG	405	2,350.000	951,750.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	157,558	79.340	12,500,651.720	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	145.900	602,129.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,850.000	266,400.000	
	CLARIANT AG-REG	12,888	24.340	313,693.920	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	510.400	916,168.000	
	ABB LTD	126,278	22.990	2,903,131.220	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	72.940	900,152.540	
	GEBERIT AG	2,801	416.300	1,166,056.300	
	LONZA GROUP AG-REG	5,389	237.500	1,279,887.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,570.000	417,750.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	66,800.000	601,200.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,141.000	1,481,572.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,843	305.900	3,316,873.700	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	53.780	1,757,315.280	
	SONOVA HOLDING AG	3,168	145.100	459,676.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	161.350	594,897.450	
	STRAUMANN HOLDING AG	600	653.000	391,800.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	403.600	789,038.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	76.000	348,992.000	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	216.200	359,540.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	332.600	740,035.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	130.000	396,500.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	628.500	347,560.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.950	520,830.500	
	DUFREY GROUP	2,390	136.650	326,593.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	680.500	865,596.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	60.540	921,842.580	
	SWISS RE LTD	20,638	94.880	1,958,133.440	
	UBS GROUP AG	260,639	17.545	4,572,911.250	
	スイス・フラン 小計	1,172,858		78,789,750.240 (9,064,760,765)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	341.300	16,511,070.100	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	25,793	302.500	7,802,382.500	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	53.060	11,765,948.880	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	100.900	1,327,137.700	
	LUNDBERGS B	3,691	609.000	2,247,819.000	
	SKF AB-B SHS	24,866	169.500	4,214,787.000	
	SANDVIK AB	76,781	145.500	11,171,635.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	95,918	96.200	9,227,311.600	

	SKANSKA AB-B SHS	21,179	164.400	3,481,827.600	
	SWEDBANK AB	66,507	204.200	13,580,729.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	114.300	12,388,748.400	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	152.800	17,369,081.600	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	322.300	3,700,326.300	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	95.260	2,569,733.760	
	NORDEA AB	218,620	93.760	20,497,811.200	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	195.500	2,229,286.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	263.900	5,064,504.900	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	137.300	3,308,655.400	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	362.600	12,115,191.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	135.000	8,970,480.000	
	ASSA ABLOY AB-B	68,613	172.050	11,804,866.650	
	TELIA CO AB	184,927	37.160	6,871,887.320	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	183.550	3,081,804.500	
	BOLIDEN AB	21,855	283.300	6,191,521.500	
	ALFA LAVAL AB	17,411	195.500	3,403,850.500	
	KINNEVIK AB-B	18,310	285.600	5,229,336.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	558.000	2,975,256.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	292.900	1,733,968.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	85.520	2,881,339.840	
	HEXAGON AB	18,360	489.800	8,992,728.000	
	ESSITY AB-B	39,797	222.800	8,866,771.600	
スウェーデン・クローネ 小計		1,662,709		231,577,798.450 (3,110,089,833)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	711.600	5,216,028.000	
	A P MOLLER A/S	481	10,565.000	5,081,765.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	10,050.000	2,743,650.000	
	DANSKE BANK A/S	50,188	244.200	12,255,909.600	
	GENMAB A/S	3,899	1,074.500	4,189,475.500	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	305.600	4,860,262.400	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,728	303.350	39,959,688.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	430.000	6,797,440.000	
	TDC A/S	68,939	49.250	3,395,245.750	
	COLOPLAST-B	8,286	509.400	4,220,888.400	
	DSV A/S	13,040	473.200	6,170,528.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	187.200	1,223,726.400	
	H LUNDBECK A/S	4,840	317.400	1,536,216.000	
	TRYG A/S	11,107	142.600	1,583,858.200	
	PANDORA A/S	8,251	602.600	4,972,052.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	508.000	3,915,664.000	
	ISS A/S	11,125	225.800	2,512,025.000	
ORSTED A/S	11,600	364.000	4,222,400.000		
デンマーク・クローネ 小計		377,044		114,856,823.650 (2,051,342,870)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.260	613,429.920	
	FISHER & PAYKEL	37,249	12.800	476,787.200	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	7.050	530,731.050	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.390	541,121.970	
ニュージーランド・ドル 小計		370,145		2,162,070.140 (170,327,886)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	24,816	145.700	3,615,691.200	
	DNB ASA	70,426	156.150	10,997,019.900	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	56.340	5,176,462.860	
	TELENOR ASA	53,178	174.000	9,252,972.000	
	ORKLA ASA	61,421	84.200	5,171,648.200	
	STATOIL ASA	81,414	172.250	14,023,561.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	340.000	3,834,860.000	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	141.300	2,357,307.900		
ノルウェー・クローネ 小計		411,096		54,429,523.560 (746,228,768)	
ユーロ	CRH PLC	58,956	27.430	1,617,163.080	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	92.450	577,442.700	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	84.800	981,644.800	
	UMICORE	15,320	45.950	703,954.000	
	AIR LIQUIDE	29,845	98.600	2,942,717.000	
	AIRBUS SE	41,270	84.170	3,473,695.900	
	AXA	139,550	24.850	3,467,817.500	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	19.665	680,841.630	
	ADIDAS AG	13,503	177.000	2,390,031.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.360	1,320,883.200	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	38,521	19.410	747,692.610	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,308.000	205,356.000	
	DANONE	43,686	64.260	2,807,262.360	
	SAFRAN SA	22,050	86.300	1,902,915.000	
	INTESA SANPAOLO	934,915	3.101	2,899,171.410	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	3.232	165,407.290	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,705	88.000	1,998,040.000	
	ACCOR SA	10,552	45.880	484,125.760	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	29.890	226,058.070	
	BOUYGUES	13,996	40.730	570,057.080	
	BNP PARIBAS	78,814	63.580	5,010,994.120	
	RELX NV	70,826	16.400	1,161,546.400	
	THALES SA	8,128	87.500	711,200.000	
	CAPGEMINI SA	11,481	102.000	1,171,062.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	45.090	192,263.760		
INGENICO GROUP	4,334	90.460	392,053.640		
UNICREDIT SPA	142,664	17.718	2,527,720.750		

NATIXIS	70,166	7.068	495,933.280	
KONINKLIJKE DSM NV	13,216	81.240	1,073,667.840	
COMMERZBANK AG	72,573	12.672	919,645.050	
EIFFAGE	4,777	90.200	430,885.400	
FRESENIUS SE & CO KGAA	28,530	63.240	1,804,237.200	
UNITED INTERNET	9,882	55.180	545,288.760	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	44.520	246,907.920	
PUBLICIS GROUPE	15,068	62.340	939,339.120	
MAN SE	3,396	94.050	319,393.800	
FAURECIA	3,831	69.920	267,863.520	
IBERDROLA SA	416,818	6.038	2,516,747.080	
ENI SPA	177,297	13.438	2,382,517.080	
IMERYS SA	2,256	79.000	178,224.000	
JERONIMO MARTINS	19,517	17.290	337,448.930	
KBC GROUPE	18,378	71.840	1,320,275.520	
HANNOVER RUECK SE	3,642	110.100	400,984.200	
WARTSILA OYJ	11,645	57.200	666,094.000	
L'OREAL	18,067	175.300	3,167,145.100	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	19,742	240.900	4,755,847.800	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	24.250	232,800.000	
GEA GROUP AG	11,838	37.690	446,174.220	
BOLLORE	71,347	4.360	311,072.920	
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.718	412,082.070	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	124.250	1,505,661.500	
CONTINENTAL AG	7,776	228.200	1,774,483.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	36.880	2,579,534.720	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.460	179,747.960	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	36.600	344,003.400	
AXEL SPRINGER SE	3,067	70.600	216,530.200	
OMV AG	9,766	46.460	453,728.360	
PERNOD-RICARD	15,401	131.450	2,024,461.450	
PEUGEOT SA	42,232	17.815	752,363.080	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	70.080	742,217.280	
RENAULT SA	12,442	86.100	1,071,256.200	
REPSOL SA	82,664	13.825	1,142,829.800	
REMY COINTREAU	1,860	105.500	196,230.000	
MERCK KGAA	9,551	83.160	794,261.160	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	43.240	1,543,927.440	
RWE AG	39,183	16.185	634,176.850	
SEB SA	1,405	159.000	223,395.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	49.450	573,718.900	
SOCIETE GENERALE-A	54,209	45.600	2,471,930.400	
VINCI S.A.	35,362	81.120	2,868,565.440	
SODEXO	6,286	99.400	624,828.400	
SOLVAY SA	5,036	110.800	557,988.800	

SCHNEIDER ELECTRIC SE	38,899	69.240	2,693,366.760	
VIVENDI SA	72,630	21.870	1,588,418.100	
SAP SE	69,054	83.700	5,779,819.800	
TELEFONICA S.A	322,715	7.474	2,411,971.910	
TOTAL SA	168,622	45.330	7,643,635.260	
VALEO	17,731	59.540	1,055,703.740	
E.ON SE	164,012	8.100	1,328,497.200	
VOEST-ALPINE AG	9,875	47.400	468,075.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	96.600	726,915.000	
SIEMENS AG-REG	53,706	109.280	5,868,991.680	
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	26.980	996,020.660	
ING GROEP NV-CVA	272,880	14.666	4,002,058.080	
BAYER AG	58,437	97.810	5,715,722.970	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	13.735	581,031.700	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	12,178	104.950	1,278,081.100	
DAIMLER AG	68,086	71.610	4,875,638.460	
BASF SE	65,128	86.300	5,620,546.400	
BEIERSDORF AG	6,780	91.580	620,912.400	
HOCHTIEF AG	1,707	132.300	225,836.100	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	82.880	912,425.920	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	86.140	1,296,234.720	
ORANGE	141,819	13.450	1,907,465.550	
SAMPO OYJ-A SHS	28,897	46.530	1,344,577.410	
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	57.860	450,960.840	
ALLIANZ SE	31,955	187.920	6,004,983.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,374	2.749	418,876.120	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	17.634	1,612,206.080	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	30.380	534,748.760	
HERMES INTL	2,285	434.700	993,289.500	
ENDESA S.A.	21,037	16.930	356,156.410	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	27.080	432,278.040	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	39.600	821,858.400	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	10,760	181.600	1,954,016.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	27.860	1,316,245.700	
SOCIETE BIC SA	2,478	84.700	209,886.600	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	99.920	895,383.120	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,049	28.370	426,940.130	
HEINEKEN NV	17,373	84.080	1,460,721.840	
AKZO NOBEL	18,209	77.120	1,404,278.080	
ASML HOLDING NV	27,421	152.700	4,187,186.700	
AEGON NV	120,404	5.416	652,108.060	
BANKINTER S.A.	57,960	8.810	510,627.600	
VOLKSWAGEN AG	2,183	169.800	370,673.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	166.080	2,181,294.720	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	464,350	6.968	3,235,590.800	
KERING	5,479	384.600	2,107,223.400	
CNP ASSURANCES	13,987	19.600	274,145.200	
FORTUM OYJ	29,739	17.500	520,432.500	
AGEAS	12,993	40.760	529,594.680	
UCB SA	8,747	66.220	579,226.340	
THYSSENKRUPP AG	29,903	22.940	685,974.820	
UNILEVER NV-CVA	115,530	43.745	5,053,859.850	
CARREFOUR SA	39,144	18.630	729,252.720	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	18.485	536,249.850	
ATOS SE	7,050	120.700	850,935.000	
NOKIA OYJ	417,248	4.523	1,887,212.700	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	67,529	30.705	2,073,477.940	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	39.610	814,302.380	
SANOFI	79,878	63.890	5,103,405.420	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	17.865	819,396.090	
ELISA OYJ	9,517	34.580	329,097.860	
BANCO SANTANDER SA	1,145,690	5.494	6,294,420.860	
METSO OYJ	8,585	25.560	219,432.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	16.145	558,552.420	
QIAGEN N.V.	13,642	26.320	359,057.440	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	64.050	201,693.450	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	12.932	1,930,023.400	
BMW VORZUG	4,116	76.350	314,256.600	
K & S	14,982	21.210	317,768.220	
ENEL SPA	579,218	4.780	2,768,662.040	
COLRUYT NV	4,673	43.460	203,088.580	
VOPAK (KON.)	5,364	34.240	183,663.360	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	232,897	13.070	3,043,963.790	
LEONARDO SPA	26,269	8.802	231,219.730	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,930	67.360	264,724.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	21.880	1,789,215.120	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.587	592,337.620	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	480.400	381,437.600	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.973	181,500.210	
TELEPERFORMANCE	3,607	114.900	414,444.300	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	104.600	1,448,082.400	
EURAZEO	2,427	79.300	192,461.100	
BANCO SABADELL	367,753	1.802	662,690.900	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	90.800	527,911.200	
FRAPORT AG	3,149	86.820	273,396.180	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	79.900	640,318.600	
INDITEX	75,658	26.270	1,987,535.660	
JC DECAUX SA	6,058	32.640	197,733.120	
ANDRITZ AG	6,265	46.940	294,079.100	
MAPFRE SA	84,474	2.710	228,924.540	

ESSILOR INTL	14,632	107.850	1,578,061.200	
SNAM SPA	158,419	3.686	583,932.430	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	13.570	1,161,388.450	
ENAGAS	18,095	20.660	373,842.700	
WENDEL	2,220	139.500	309,690.000	
WIRECARD AG	7,990	94.300	753,457.000	
TENARIS SA	30,372	12.930	392,709.960	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.688	545,008.140	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.594	295,572.020	
ATLANTIA SPA	34,969	25.200	881,218.800	
ILIAD SA	2,102	196.100	412,202.200	
PROXIMUS	8,922	25.540	227,867.880	
SES FDR	24,585	11.240	276,335.400	
TERNA SPA	81,915	4.578	375,006.870	
GRIFOLS SA	18,800	23.340	438,792.000	
FERROVIAL SA	36,997	17.005	629,133.980	
LANXESS AG	6,856	66.840	458,255.040	
NESTE OYJ	8,839	57.100	504,706.900	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	31.820	306,776.620	
RECORDATI SPA	6,859	31.070	213,109.130	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.175	219,725.020	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,134	133.600	418,702.400	
KONE OYJ	23,717	43.660	1,035,484.220	
ENGIE	129,539	12.615	1,634,134.480	
ALSTOM	12,046	33.180	399,686.280	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	56.600	205,684.400	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	16.700	209,451.400	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	10.435	362,678.860	
IPSEN SA	2,487	109.200	271,580.400	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	33.500	894,919.000	
ARKEMA SA	3,796	98.780	374,968.880	
LEGRAND SA	19,920	61.600	1,227,072.000	
ADP	2,313	164.200	379,794.600	
ORION OYJ	8,051	26.000	209,326.000	
RTL GROUP SA	3,446	69.400	239,152.400	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.530	550,992.130	
SYMRISE AG	7,926	65.460	518,835.960	
SCOR SE	13,875	35.300	489,787.500	
REXEL SA	23,245	14.440	335,657.800	
PRYSMIAN SPA	14,925	26.070	389,094.750	
CAIXABANK	262,372	3.991	1,047,126.650	
BUREAU VERITAS SA	21,480	21.610	464,182.800	
GETLINK	37,646	10.625	399,988.750	
SUEZ SA	25,406	11.095	281,879.570	
AMADEUS IT GROUP SA	30,169	58.560	1,766,696.640	

BRENNTAG AG	9,600	50.760	487,296.000	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.774	303,116.170	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	29.860	345,629.500	
EDENRED	13,195	25.500	336,472.500	
BANKIA SA	63,197	3.834	242,297.290	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.932	241,979.210	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	72.800	379,870.400	
OSRAM LICHT AG	7,017	67.220	471,682.740	
KION GROUP AG	4,686	68.300	320,053.800	
VONOVIA SE	35,308	36.740	1,297,215.920	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.655	561,011.980	
FERRARI NV	8,338	100.800	840,470.400	
METRO AG	10,774	18.000	193,932.000	
INNOGY SE	9,769	31.420	306,941.980	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERV-RTS	15,000	0.410	6,150.000	
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	11.200	880,824.000	
AIB GROUP PLC	52,322	5.450	285,154.900	
LINDE AG-TENDER	13,375	188.700	2,523,862.500	
NN GROUP NV	21,965	36.260	796,450.900	
ZALANDO SE	6,674	46.480	310,207.520	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	17.700	1,357,926.300	
AENA SME SA	5,256	165.650	870,656.400	
ABN AMRO GROUP NV	29,129	24.570	715,699.530	
EXOR NV	7,726	59.720	461,396.720	
ALTICE NV-A	43,403	7.884	342,189.250	
COVESTRO AG	10,500	87.140	914,970.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	53,680	83.590	4,487,111.200	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.528	261,217.920	
AMUNDI SA	3,894	67.720	263,701.680	
SCHAEFFLER AG	12,644	13.110	165,762.840	
UNIPER SE	13,897	24.110	335,056.670	
ユーロ 小計	13,921,373		274,094,147.350 (36,470,967,246)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	16,600	105.300	1,747,980.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.540	3,040,560.000	
BANK OF EAST ASIA	76,260	32.350	2,467,011.000	
CLP HOLDINGS LTD	119,500	76.500	9,141,750.000	
PCCW LTD	331,000	4.450	1,472,950.000	
LI & FUNG LTD	532,400	3.950	2,102,980.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	65.400	3,204,600.000	

HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	79,040	272.800	21,562,112.000	
MTR CORP	118,500	40.600	4,811,100.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	26.900	1,694,700.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	191.500	10,724,000.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	49.750	4,171,239.000	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	65.850	6,354,525.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	28.650	2,743,237.500	
HONG KONG & CHINA GAS	610,046	14.840	9,053,082.640	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	43.600	2,180,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	65.650	10,766,600.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	34.750	1,146,750.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	39.000	10,218,000.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	34.350	1,734,675.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.600	5,118,685.600	
SINO LAND CO	255,400	13.680	3,493,872.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	126.000	12,978,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	74.250	2,227,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	47.900	5,436,650.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	56.550	3,166,800.000	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	258,000	4.990	1,287,420.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	43.050	1,894,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.360	1,148,160.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	26.750	3,327,700.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	21.850	1,415,880.000	
AIA GROUP LTD	849,627	62.400	53,016,724.800	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	9.720	2,741,040.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	43.900	7,427,880.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	25.900	2,698,780.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	50.750	4,859,312.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.240	1,665,200.000	
WH GROUP LTD	530,500	9.050	4,801,025.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	97.850	19,504,636.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	67.750	12,488,493.000	
香港・ドル 小計	7,342,247		261,035,811.240 (3,565,749,182)	
合計	80,804,116		272,128,639,179 (272,128,639,179)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	63,819.000	589,049.370	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	976,600.570	
		GPT GROUP	144,955.000	687,086.700	
		LENLEASE GROUP	37,363.000	592,950.810	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	621,144.300	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,442,666.880	
		STOCKLAND	126,459.000	503,306.820	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	692,334.080	
	WESTFIELD CORP	140,035.000	1,191,697.850		
	オーストラリア・ドル	小計	1,584,164.000	7,296,837.380 (617,677,284)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	516,071.420	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	390,040.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	366,911.000	
	シンガポール・ドル	小計	591,906.000	1,273,022.420 (103,458,532)	
投資信託受益証券	合計		2,176,070	721,135,816 (721,135,816)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	485,732.670	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	876,918.240	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,158,287.640	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	804,740.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,642.000	1,532,306.640	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,289,457.280	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	329,844.750	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	508,393.650	
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	326,281.300	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,166.000	2,967,569.760	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,591,471.860	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	624,719.100	
		EQUINIX INC	5,448.000	2,374,401.840	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,534,056.900	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,016,814.240	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	660,560.740	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,144.000	459,238.080	
		GGP INC	43,463.000	945,754.880	
		HCP INC	34,130.000	743,010.100	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	1,004,527.080	
INVITATION HOMES INC	22,567.000	481,128.440			

	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	639,405.350	
	KIMCO REALTY	32,980.000	470,294.800	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	458,388.150	
	MID AMERICA	8,123.000	713,605.550	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	390,760.640	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,359,001.640	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,082,783.780	
	REALTY INCOME CORP	18,985.000	913,178.500	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	651,212.040	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,327,952.640	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	21,825.000	3,363,014.250	
	SL GREEN	5,382.000	504,777.780	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	554,901.840	
	UDR INC	17,458.000	589,905.820	
	VENTAS INC	25,041.000	1,242,534.420	
	VEREIT INC	72,429.000	501,932.970	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	806,902.880	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,435,841.400	
	WEYERHAEUSER CO	51,939.000	1,815,787.440	
アメリカ・ドル 小計		910,976.000	45,537,397.720 (4,866,126,320)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	456,668.330	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	269,516.360	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,974.000	353,424.010	
	SEGRO PLC	61,113.000	338,321.560	
イギリス・ポンド 小計		229,574.000	1,417,930.260 (212,235,801)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	216,142.280	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	228,910.500	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	75,265.300	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	520,318.080 (44,476,789)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	202,200.900	
	GECINA SA	3,670.000	545,362.000	
	ICADE	2,234.000	182,741.200	
	KLEPIERRE	17,042.000	569,032.380	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,352,493.300	
ユーロ 小計		32,510.000	2,851,829.780 (379,464,471)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	10,701,075.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	10,701,075.000 (146,176,685)	
投資証券 合計		1,359,565	5,648,480,066 (5,648,480,066)	
合計			6,369,615,882 (6,369,615,882)	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 602銘柄	62.76%	-%	-%	65.85%
	投資証券 40銘柄	-%	-%	1.71%	
イギリス・ポンド	株式 99銘柄	6.84%	-%	-%	7.06%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.07%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.48%	-%	-%	2.76%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.22%	-%	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.60%	-%	-%	3.69%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.48%	-%	-%	0.53%
	投資信託 受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 36銘柄	3.19%	-%	-%	3.25%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.09%	-%	-%	1.12%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.72%	-%	-%	0.74%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.26%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 238銘柄	12.82%	-%	-%	13.23%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.25%	-%	-%	1.33%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成30年2月28日現在

資産総額	127,428,633,283円
負債総額	128,815,093円
純資産総額(-)	127,299,818,190円
発行済数量	37,398,760,025口
1口当たり純資産額(/)	3.4039円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年2月28日現在

資産総額	303,411,794,165円
負債総額	9,715,761,664円
純資産総額(-)	293,696,032,501円
発行済数量	86,581,187,826口
1口当たり純資産額(/)	3.3921円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(平成30年2月28日現在)

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(平成30年2月28日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役(監査等委員である取締役を除く。)の補欠として選任された取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、現任取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長があたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

平成30年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,257,720,530,964
追加型株式投資信託	857	12,384,185,355,140
単位型公社債投資信託	55	221,953,626,069
単位型株式投資信託	138	898,562,479,964
合計	1,088	14,762,421,992,137

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

（単位：千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	-	17,124,479
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	24,580,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

（単位：千円）

	第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）		第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
時効成立後支払分配金・償還金		-		39
時効後支払損引当金繰入額		-		209,210
営業外費用計		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

（３）【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
					別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の 積立	-	-			-
当期純利益	5,126,556	5,126,556			5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の積立	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企業年金制度（キャッシュバランスタイプ）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>(5) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(6) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	-	942,315
旧本社不動産賃借料	-	418,583
賃貸借契約解約損	-	150,723

(株主資本等変動計算書関係)

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成28年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

（注）普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29年6月21日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種 類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定してあります。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っているデリバティブ取引は後述するリスクを低減する目的で行っております。当該デリバティブ取引は、実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引（為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されてあります。

有価証券及び投資有価証券は、主に其他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されてあります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰りを確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第31期（平成28年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

第32期(平成29年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第31期(平成28年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	365,683	146,101	219,581
投資信託	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額77,696千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	5,927	3,377	-

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	717,905	2	79,146

(注) 投資信託の「売却額」、「売却の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付企業年金制度(積立型制度であります)及び退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度(複数事業主制度を含む)

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の発生額	-	1,894
事業主からの拠出額	-	37,402
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
年金資産の期末残高	-	1,363,437

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	1,275,346
年金資産	-	1,363,437
	-	88,090
非積立型制度の退職給付債務	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
前払年金費用	-	325,140
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
株式	-	31.5%
債券	-	29.0%
共同運用資産	-	24.1%
生命保険一般勘定	-	10.5%
現金及び預金	-	4.6%
合計	-	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
退職給付引当金の期末残高	-	300,927

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	789,261
年金資産	-	1,150,443
		361,181
非積立型制度の退職給付債務	-	60,254
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927
退職給付引当金	-	60,254
前払年金費用	-	361,181
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 - 千円 当事業年度22,562千円

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
繰延税金負債		
前払年金費用	-	210,151
その他有価証券評価差額金	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2) 子会社及び関連会社等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払 増資の引受	800,617	未払費用	308,974
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3) 兄弟会社等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイ ナンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言 金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払費 用 未払金	292,861 7,581
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信 託銀行株 式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託銀 行業	-	-	投資一任契 約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 当社預り資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注4) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注5) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注6) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれておりません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22銭

(注1) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株主及び普通株主と同等の 株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の 株式に係る当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		38,311,736
金銭の信託		12,187,115
有価証券		10,007
未収委託者報酬		10,291,857
未収運用受託報酬		4,862,664
未収投資助言報酬		324,278
未収収益		55,950
前払費用		764,943
繰延税金資産		727,622
その他		498,289
	流動資産計	68,034,465
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,200,157
器具備品	1	573,952
建設仮勘定		7,907
無形固定資産		
ソフトウェア		1,050,789
ソフトウェア仮勘定		502,759
電話加入権		3,934
電信電話専用施設利用権		81
投資その他の資産		
投資有価証券		1,939,084
関係会社株式		3,229,196
長期差入保証金		1,566,055
繰延税金資産		906,695
その他		101,155
	固定資産計	11,081,771
資産合計		79,116,236

(単位:千円)

	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	970,622
未払金	4,511,170
未払収益分配金	1,016
未払償還金	57,332
未払手数料	4,075,374
その他未払金	377,447
未払費用	7,061,067
未払法人税等	3,136,528
未払消費税等	1,025,584
前受収益	66,578
賞与引当金	1,376,046
役員賞与引当金	24,993
本社移転費用引当金	347,010
流動負債計	18,519,601
固定負債	
退職給付引当金	1,423,210
時効後支払損引当金	199,012
固定負債計	1,622,222
負債合計	20,141,823
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	36,673,439
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	36,550,146
別途積立金	24,580,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	11,470,146
株主資本計	58,226,396
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	748,016
評価・換算差額等計	748,016
純資産合計	58,974,413
負債・純資産合計	79,116,236

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日至平成29年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,132,996	
運用受託報酬	9,310,831	
投資助言報酬	593,439	
その他営業収益	57,716	
	営業収益計	52,094,984
営業費用		
支払手数料	18,688,374	
広告宣伝費	177,047	
公告費	860	
調査費	11,809,998	
調査費	5,371,951	
委託調査費	6,438,046	
委託計算費	550,197	
営業雑経費	555,637	
通信費	24,831	
印刷費	438,120	
協会費	27,130	
諸会費	29	
支払販売手数料	65,526	
	営業費用計	31,782,116
一般管理費		
給料	5,014,947	
役員報酬	93,260	
給料・手当	4,921,687	
交際費	22,147	
寄付金	4,057	
旅費交通費	181,947	
租税公課	331,327	
不動産賃借料	773,059	
退職給付費用	260,989	
固定資産減価償却費	1 720,970	
福利厚生費	22,315	
修繕費	1,799	
賞与引当金繰入額	1,376,046	
役員賞与引当金繰入額	24,993	
機器リース料	104	
事務委託費	1,549,368	
事務用消耗品費	75,575	
器具備品費	3,469	
諸経費	90,183	
	一般管理費計	10,453,305
営業利益		9,859,563

（単位：千円）

	第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日至平成29年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	593	
受取配当金	46,072	
時効成立分配金・償還金	85	
投資信託解約益	217,088	
投資信託償還益	93,060	
時効後支払損引当金戻入額	17,443	
雑収入	3,498	
	営業外収益計	377,842
営業外費用		
為替差損	8,306	
投資信託解約損	1,365	
投資信託償還損	17,053	
金銭の信託運用損	31,660	
	営業外費用計	58,386
経常利益		10,179,019
特別利益		
投資有価証券売却益	132,762	
関係会社株式売却益	1,492,680	
本社移転費用引当金戻入額	122,238	
その他特別利益	0	
	特別利益計	1,747,681
特別損失		
固定資産除却損	18,065	
固定資産売却損	134	
退職給付制度終了損	690,899	
その他特別損失	50	
	特別損失計	709,149
税引前中間純利益		11,217,551
法人税、住民税及び事業税		3,407,636
法人税等調整額		163,880
法人税等合計		3,243,755
中間純利益		7,973,795

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日至平成29年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当中間期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
中間純利益									7,973,795
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額(純 額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	-	-	4,773,795
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	11,470,146

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
中間純利益	7,973,795	7,973,795			7,973,795
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額(純 額)			230,151	230,151	230,151
当中間期変動額 合計	4,773,795	4,773,795	230,151	230,151	5,003,947
当中間期末残高	36,673,439	58,226,396	748,016	748,016	58,974,413

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="564 689 922 763"> <tr> <td>建物</td> <td>...</td> <td>6～18年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>2～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>	建物	...	6～18年	器具備品	...	2～20年
建物	...	6～18年					
器具備品	...	2～20年					
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						

5．引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
<p>当社は、当中間会計期間においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の減価償却費が286,788千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ同額減少しております。</p>

追加情報

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
--

当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」(企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日)及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第2号 平成19年2月7日)を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。

本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物 ... 97,109千円 器具備品 ... 774,035千円

(中間損益計算書関係)

項目	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産 ...
	無形固定資産 ...	578,697千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式				

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第33期中間会計期間末(平成29年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	38,311,736	38,311,736	-
(2) 金銭の信託	12,187,115	12,187,115	-
(3) 未収委託者報酬	10,291,857	10,291,857	-
(4) 未収運用受託報酬	4,862,664	4,862,664	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,641,123	1,641,123	-
資産計	67,294,496	67,294,496	-
(1) 未払手数料	4,075,374	4,075,374	-
負債計	4,075,374	4,075,374	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	307,968
関係会社株式	3,229,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(有価証券関係)

第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)			
1. 子会社株式			
関係会社株式(中間貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
2. その他有価証券			
区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,189,247	146,101	1,043,145
投資信託	423,152	385,910	37,242
小計	1,612,400	532,011	1,080,388
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	28,723	30,967	2,244
小計	28,723	30,967	2,244
合計	1,641,123	562,979	1,078,144
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額307,968千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成29年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	118,742,638千円
資産合計	118,742,638千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,822,169千円
負債合計	13,822,169千円
純資産	104,920,468千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん

72,413,595千円及び顧客関連資産の金額47,817,519千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,506,064千円
経常利益	4,506,064千円
税引前中間純利益	4,506,064千円
中間純利益	3,709,808千円
1株当たり中間純利益	92,745円22銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,616,680千円が含まれております。

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）

1．セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

（3）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

（1株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,474,360円32銭
1株当たり中間純利益金額	199,344円89銭

（注）潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
中間純利益金額	7,973,795千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,973,795千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

(注) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成30年3月23日に臨時株主総会が開催され、定款の変更を行うことについて決議されました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成29年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成29年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2)信託財産の計算
- (3)信託財産に関する報告書の作成
- (4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成29年5月15日
有価証券報告書	平成29年5月15日
有価証券届出書の訂正届出書	平成29年11月15日
半期報告書	平成29年11月15日

独立監査人の監査報告書

平成29年6月7日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原	尚	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野	浩	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において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、アセットマネジメントOne株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年3月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M外国株式インデックスファンド< D C年金 >の平成29年2月16日から平成30年2月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において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、D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金 >の平成30年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月24日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原	尚	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野	浩	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注1）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。