

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	2019年2月12日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	三木谷 正直
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	3,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下、「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）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（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。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」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

3,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 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1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

#### <基準価額の照会方法等>

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、公表されません。

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）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

( 5 ) 【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

( 7 ) 【申込期間】

継続申込期間：2019年2月13日から2019年8月13日まで

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれか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。 )には、お申込みの受付は行いません。

( 8 ) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・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)

( 9 ) 【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、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経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。

( 10 ) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、販売会社に買付代金を支払うものとし、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・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)

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**(12) 【その他】**

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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。

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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。

**振替受益権について**

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

**(参考)****投資信託振替制度**

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

## 第二部【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、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。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 世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。



●各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド（マザーファンド）を通じて行います。

投資対象のマザーファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	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)
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

※リート(REIT)はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに連動する投資成果をめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用します。また、上記マザーファンドには運用管理費用(信託報酬)はかかりません。

## 2 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。

### ●基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にしております。\*

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

\*2018年11月末時点

## 3 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。運用管理費用(信託報酬)は信託財産の純資産総額に対して年率0.54%(税抜0.50%)と、低水準に設定しました。

### ●換金価額は、基準価額から信託財産留保額(換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%)を差し引いた価額となります。

## 4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

決算ごとに分配することを重視します。隔月(奇数月)に利息・配当等収益を中心とした分配と、さらに5月・11月に売買益(評価益を含みます。)等を加えた分配をめざします。

※決算は原則として年6回(毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)です。

- ・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。

## 収益分配金に関する留意事項

投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

### 投資信託から分配金が支払われるイメージ



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、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。また、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。

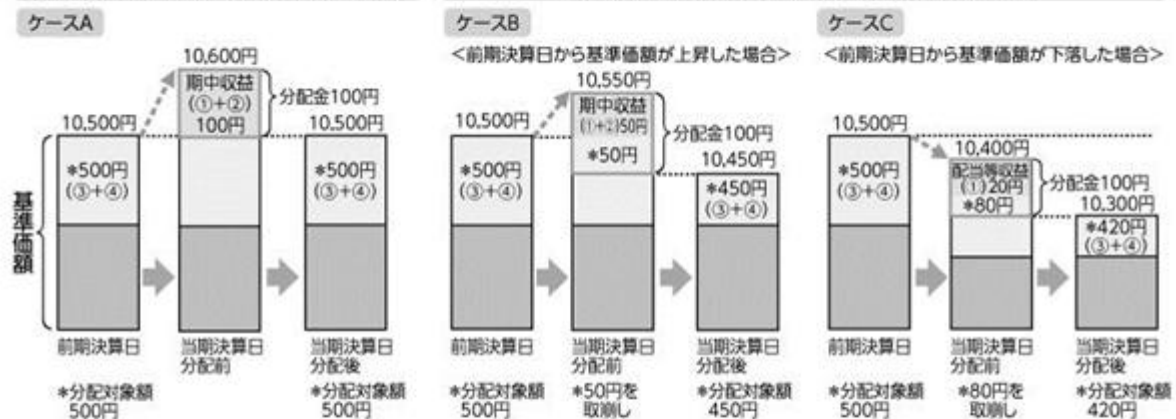
### 分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円

ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円

ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

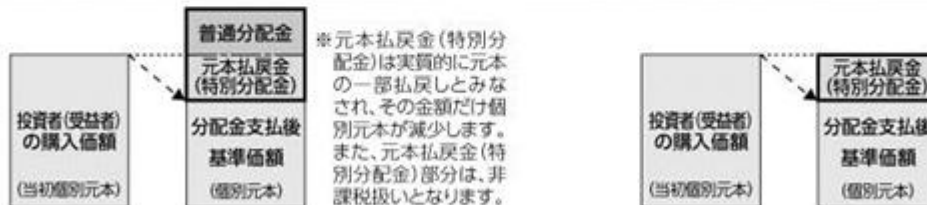
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありません。

投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

⑤ 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

## 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)
単位型投信	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
追加型投信	内外	その他資産 ( )
		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。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回	グローバル (日本を含む)		
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)	日本  北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	あり ( )
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信) 資産配分変更 型))	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
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

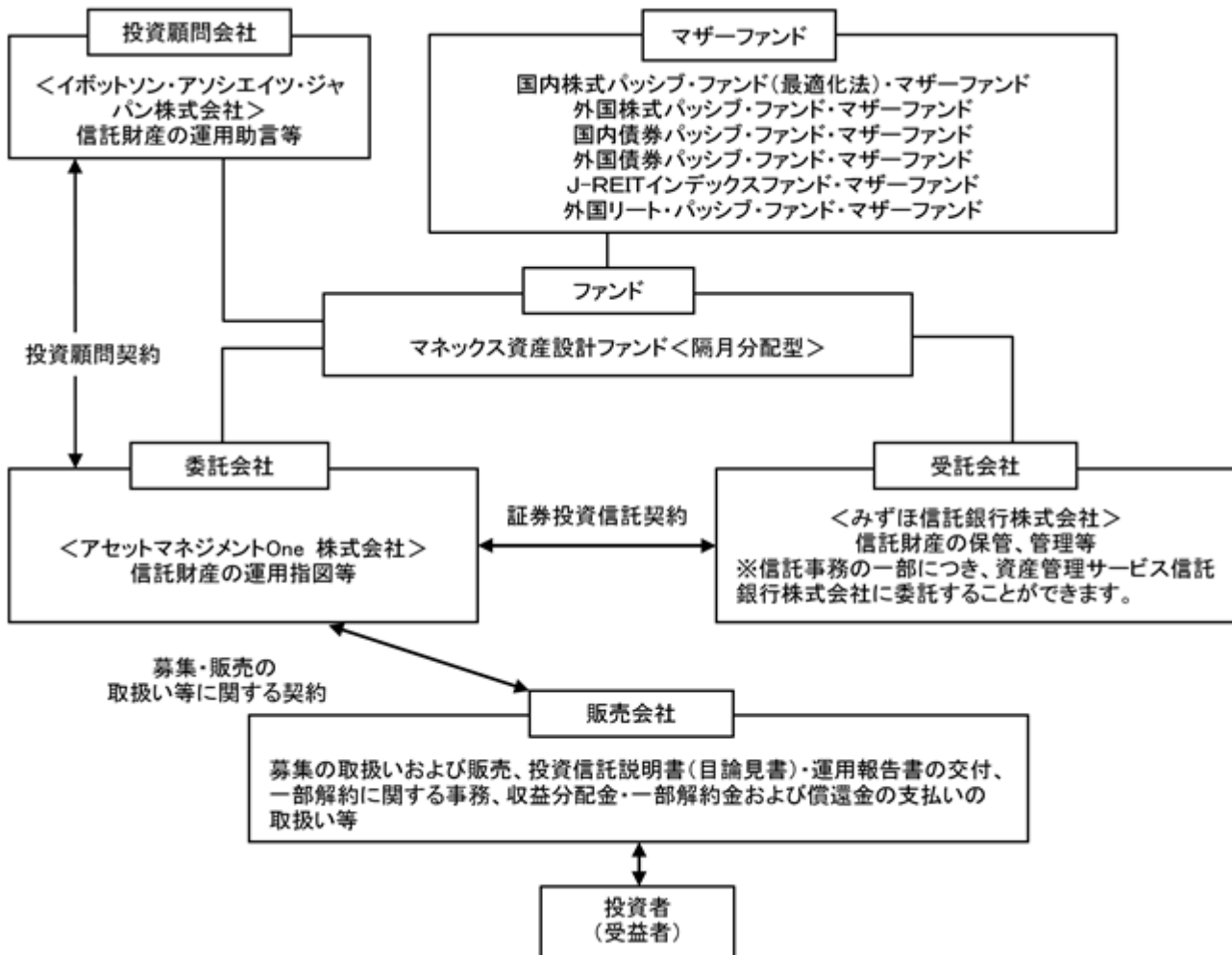
<p>その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券、不動産投信） 資産配分変更型））</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。</p> <p>（注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。</p>
<p>年6回（隔月）</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>グローバル （日本を含む）</p>	<p>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含む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。</p>
<p>ファミリー ファンド</p>	<p>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。</p>
<p>為替ヘッジなし</p>	<p>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。</p>

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（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

## （２）【ファンドの沿革】

2007年1月26日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2016年4月13日	外国リートの投資対象マザーファンドを「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」から「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」へ変更
2018年10月12日	信託報酬率(税抜)を「年率0.95%」から「年率0.50%」に引き下げ

## (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・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。

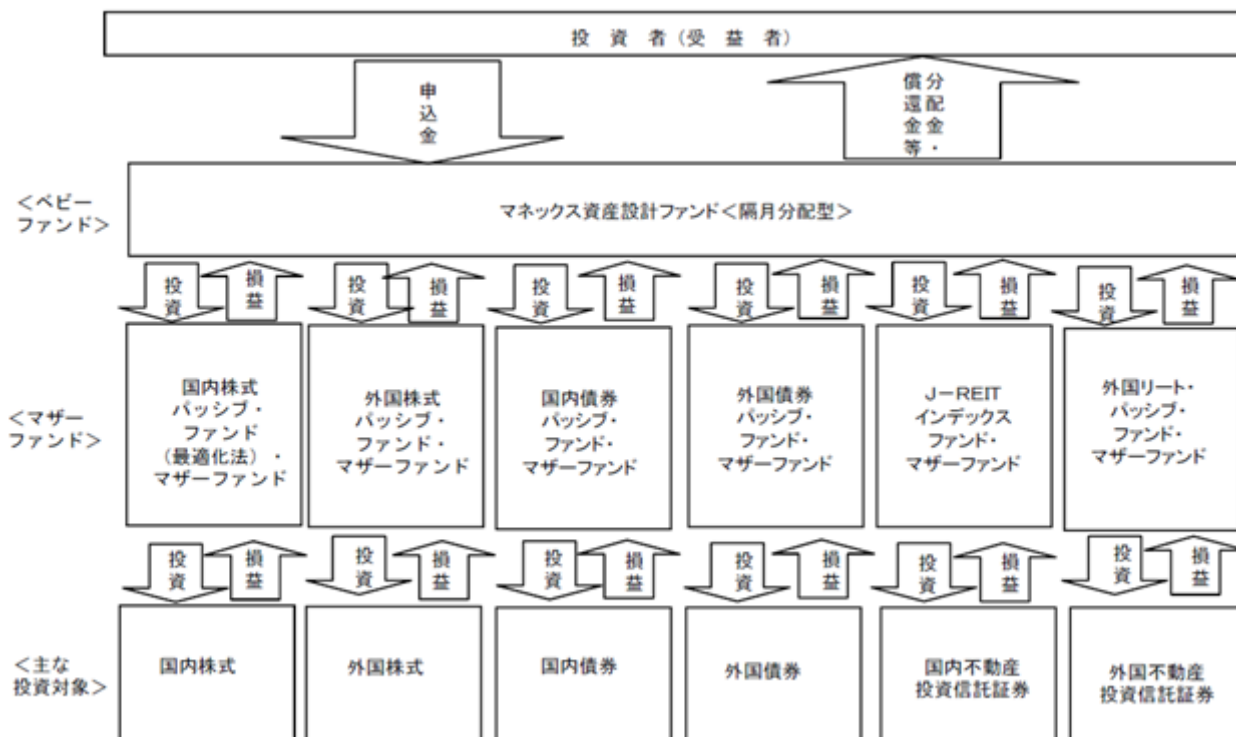
- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

## 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各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（2018年11月30日現在）

## 委託会社の沿革

- |            |   |
|------------|---|
| 1985年7月1日  | 会社設立  |
| 1998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   |
| 1998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  |
| 1999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。 |
| 2008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「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更  |

2016年10月1日

D I A M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

(2018年11月30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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

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】

## &lt;基本方針&gt;

この投資信託は、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

## &lt;投資対象&gt;

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、J-REITインデックスファンド・マザーファンド受益証券および外国リート・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。

## &lt;投資態度&gt;

主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよび外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の計6資産への分散投資を行います。

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

リート(REIT)とは

- ・リート(REIT)とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。(以下同じ。)
- ・REIT(リート)とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT(Listed Property Trust)と呼ばれる場合があります。
- ・リート(REIT)は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート(REIT)は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート(REIT)は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート(REIT)に投資する投資家が、配当金(もしくは分配金)として享受する仕組みになっています。

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

#### <運用プロセス>

- ・基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。
- ・分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。
- ・決定した基本資産配分比率に基づき、6つのマザーファンドへ投資を行いポートフォリオを構築します。
- ・時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

#### (2)【投資対象】

##### 1.投資の対象とする資産(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。

1)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23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

## 2)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、主として次に掲げる1)から6)までの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親投資信託の受益証券ならびに7)から28)までの有価証券(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) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 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。)
- 12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(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。)
- 13) 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。)
- 14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(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。)
- 15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(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。)
- 16) コマーシャル・ペーパー
- 17) 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
- 18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)から17)までの証券または証書の性質を有するもの
- 19) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- 20) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 21) 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。)
- 22) 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せん。)
- 23) 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。)
- 24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

25)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。)

26)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。)

27)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

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

なお、7)の証券または証書、18)ならびに23)の証券または証書のうち7)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、8)から12)までの証券および18)ならびに23)の証券または証書のうち8)から12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、19)の証券および20)の証券を以下「投資信託証券」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上記5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、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。(約款第16条第3項)

(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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
-------	-----------------------------



基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>(注) 東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標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。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底的なリスク管理を行います。</li> <li>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li> <li>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li> </ol>
<p>運用プロセス</p>	<p>流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>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。</p> <p>インデックスとの乖離を管理</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、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。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>

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>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>
--------	---

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	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) <sup>(注)</sup> に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

(注)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。

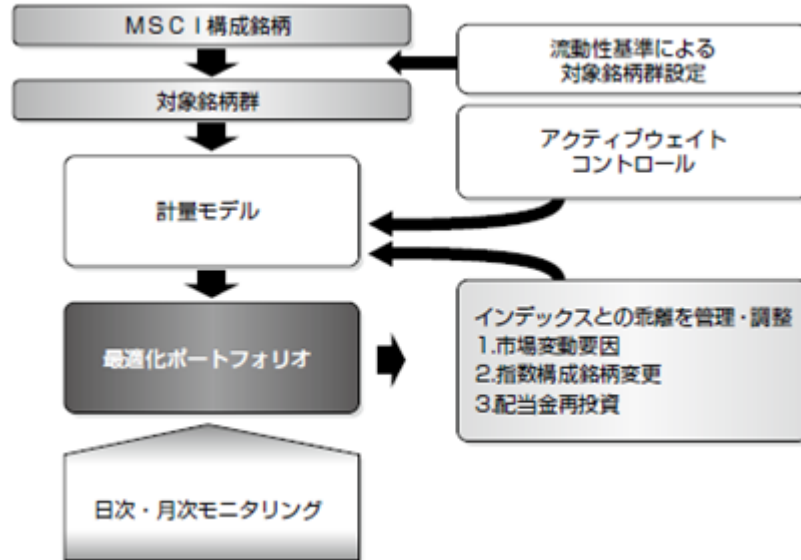
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝す

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。

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。

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。

運用プロセス



流動性基準による対象銘柄群設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

最適化法によるポートフォリオの構築

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。

インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

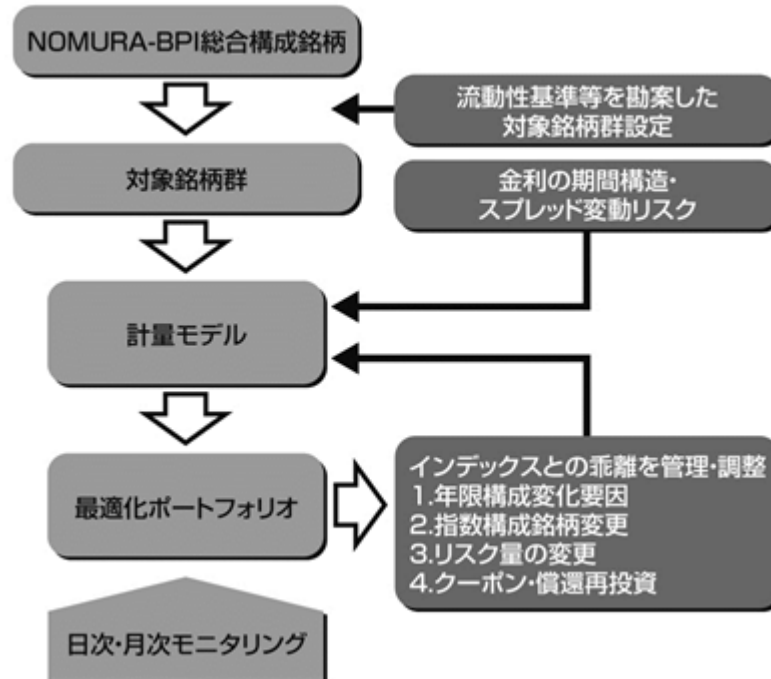
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

<p>主な投資制限</p>	<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>
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 5px 0;"> <p>(注) NOMURA - B P I 総合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。</p> </div>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>

## 運用プロセス



## 流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

## 最適化法によるポートフォリオの構築

1. 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
  2. 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
- 1.、2.が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

## インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、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。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

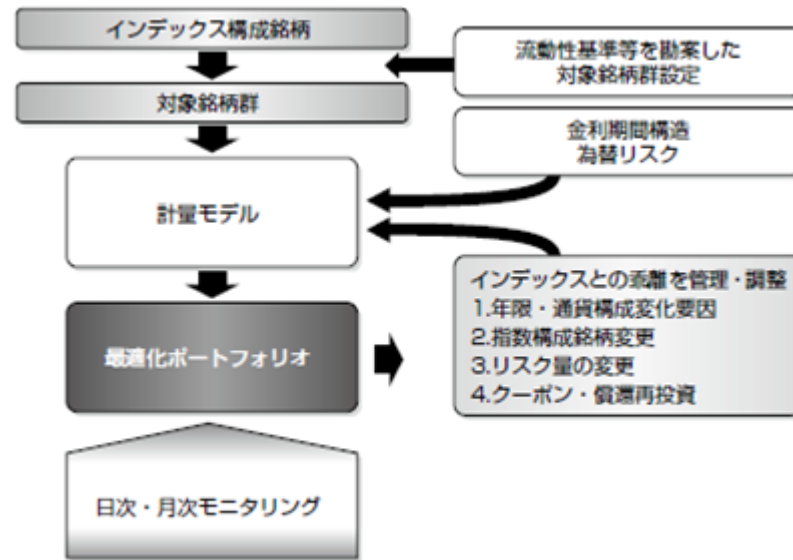
- ・ 年限構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーボン、償還再投資



主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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>
--------	--

ファンド名	外国債券パッシブ・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	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)<sup>(注)</sup>」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div data-bbox="347 1413 1385 1805" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>(注) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div> <p>外国債券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>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>

## 運用プロセス



## 流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

## 最適化法によるポートフォリオの構築

金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

## インデックスとの乖離を管理

日々・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。

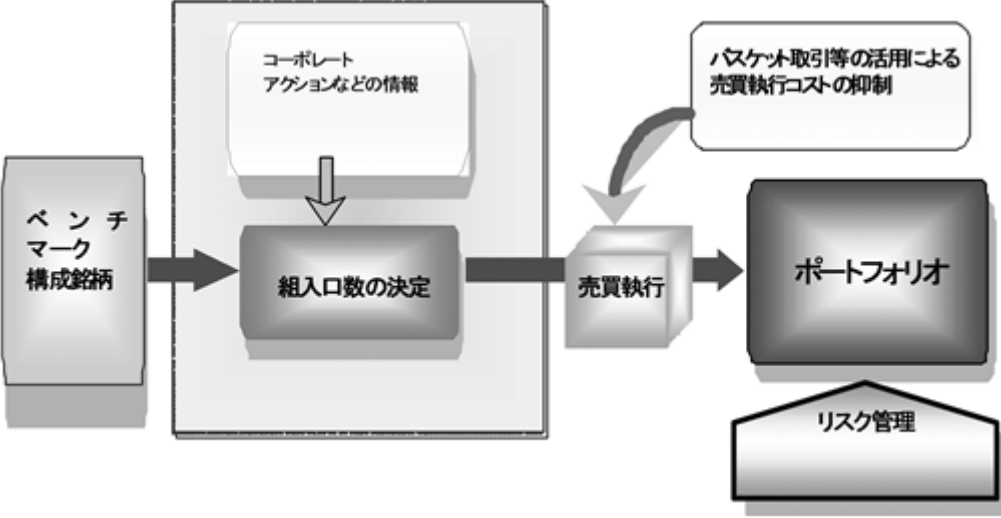
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーボン・償還再投資

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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>
--------	--

ファンド名	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
-------	--------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）<sup>(注)</sup>の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注) 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標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。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。</p>

<p>投資態度</p>	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。</p> <p>不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数(配当込み)が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前を取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</p> <p>配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</p>  <pre> graph LR     A[ベンチマーク構成銘柄] --&gt; B[組入口数の決定]     C[コーポレートアクションなどの情報] --&gt; B     B --&gt; D[売買執行]     D --&gt; E[ポートフォリオ]     E --- F[リスク管理]     G[バケット取引等の活用による 売買執行コストの抑制] -.-&gt; D   </pre>

主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</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、価格変動および金利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>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>
--------	--

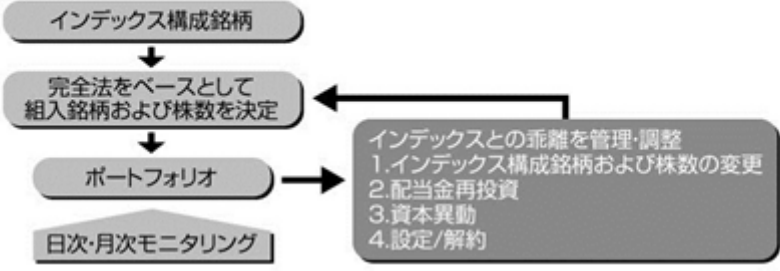
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) <sup>(注)</sup> に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

(注) S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門であるS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I T インデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I T インデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I T インデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I T インデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくは



	<p>はS &amp; P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&amp;P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&amp;P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&amp;P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。)とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、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。</li> <li>2.不動産投資信託証券への投資割合は、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。</li> <li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</li> </ol>
<p>運用プロセス</p>	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&amp;P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     C --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li><li>2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li><li>3. 株式への直接投資は行いません。</li><li>4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S &amp; P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS &amp; P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</li><li>5. 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。</li><li>6. 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。</li><li>7. 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。</li></ol>
--------	---

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2018年11月30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（原則として奇数月の各11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、配当等収入および売買益（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

原則として、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。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

留保益の運用については、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) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、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た後、その残金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額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(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、繰越欠損金のある時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. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各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各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c. 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。

#### 収益分配金の支払い

収益分配金は、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、)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

### (5) 【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。(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は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。(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、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。(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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

同一銘柄の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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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)

投資する株式等の範囲(約款第19条)

- 1) 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、株主割当ま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。
- 2) 上記1)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者が投資することを指図することができるものとします。

#### 信用取引の指図および範囲(約款第22条)

- 1) 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、当該売付けの決済については、株券の引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。
- 2) 上記1)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の行使、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

#### 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- 1) 委託会社は、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。)
- 2) 委託会社は、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行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、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行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) 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。

3)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もとに算出した価額で行うものとしします。

4)委託会社は、スワップ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します。

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25条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2)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、原則として信託期間を超えないものとしします。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。

3)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します。

4)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します。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25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します。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1)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します。

2.公社債の貸付けは、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します。

2)上記1) 1. 2.に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します。

3)委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとしします。

公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い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します。

2)上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内としします。

3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売り付けに係る公社債の時価総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売り付けの一部を決済するための指図をするものとしします。

公社債の借入れ（約款第28条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとしします。

- 2) 上記1)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れに係る公社債の時価総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借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29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。

#### 外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約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係る為替の買予約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。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約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為替の売予約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。
- 4) 上記2)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。

#### 資金の借入れ（約款第37条）

- 1) 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に資す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、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。
- 2) 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、資金借入れ額は借入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。
- 3) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### 8.2 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。

#### 資産配分リスク

各資産(国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート)への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、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。

#### 株価変動リスク

当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

#### 金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券およびリートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる場合があります。

#### リートの価格変動リスク

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

当ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

#### 為替リスク

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して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。

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。

## 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産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。

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

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およぼす場合があります。

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、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認める場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

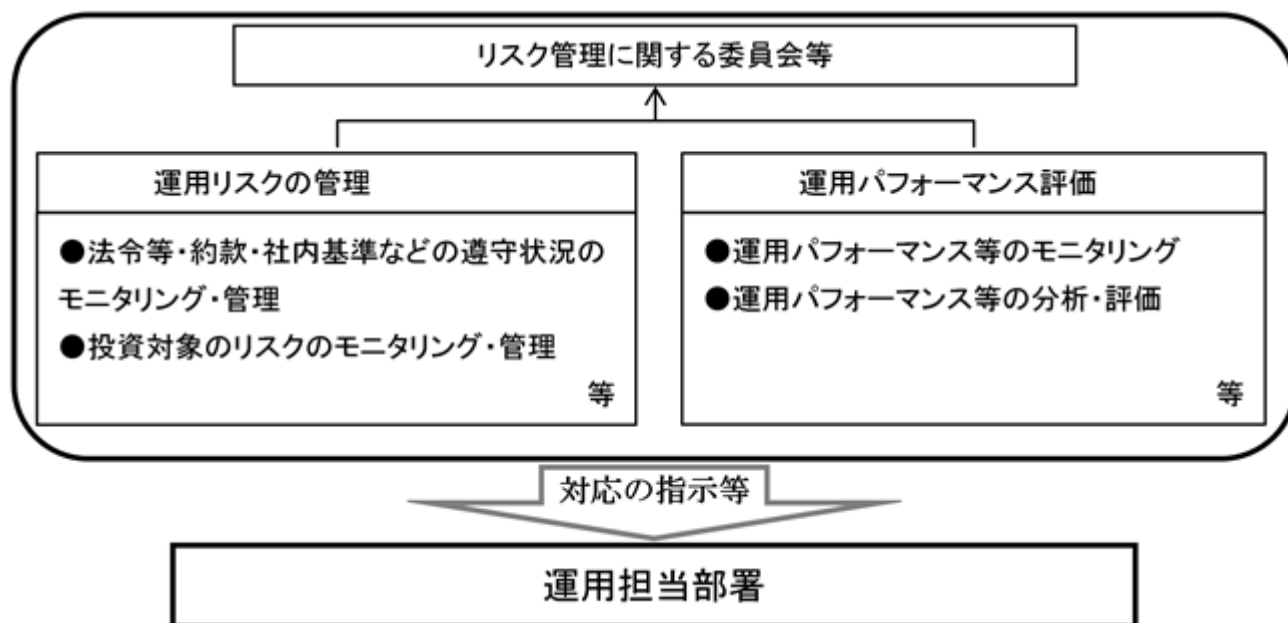
#### 注意事項

- ・当ファンドは、実質的に株式、債券、リート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。
- ・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。
- ・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。
- ・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、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、以下のとおりです。

- ・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。



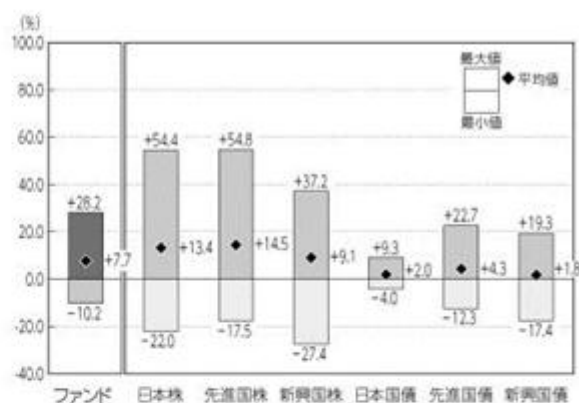
リスク管理体制は2018年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <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12月～2018年11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・ディバーシファイド (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・ディバーシファイド」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0.54%（税抜0.50%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.26%	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0.20%	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0.04%	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。

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン）に対する投資顧問報酬が含まれます。

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

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

## 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て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。

上場不動産投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託（リート）の費用は表示しておりません。

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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

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。

上記は、2018年11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11月30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	421,973,908	99.13
内 日本	421,973,908	99.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,722,703	0.87
純資産総額	425,696,611	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）

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	271,690,359,530	97.20
内 日本	271,690,359,530	97.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,812,793,899	2.80
純資産総額	279,503,153,429	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,639,440,000	2.73
内 日本	7,639,440,000	2.73

（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）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。



## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		284,691,184,700	82.37
	内 日本	284,691,184,700	82.37
地方債証券		21,904,754,639	6.34
	内 日本	21,904,754,639	6.34
特殊債券		18,035,245,808	5.22
	内 日本	18,035,245,808	5.22
社債券		15,034,634,890	4.35
	内 日本	14,428,992,890	4.17
	内 フランス	404,868,000	0.12
	内 オランダ	200,774,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,956,961,023	1.72
純資産総額		345,622,781,060	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。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券		30,752,836,550	97.32
	内 日本	30,752,836,550	97.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		846,214,970	2.68
純資産総額		31,599,051,520	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）		637,767,000	2.02
	内 日本	637,767,000	2.02

（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）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。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		317,732,258,163	95.85
	内 アメリカ	206,360,625,298	62.25
	内 イギリス	20,150,844,263	6.08
	内 カナダ	12,088,827,836	3.65
	内 フランス	12,019,775,695	3.63
	内 スイス	11,518,441,327	3.47
	内 ドイツ	10,818,430,114	3.26
	内 オーストラリア	7,661,241,069	2.31
	内 オランダ	5,782,273,840	1.74

内	アイルランド	5,631,053,490	1.70
内	スペイン	3,735,441,086	1.13
内	香港	3,058,138,874	0.92
内	スウェーデン	2,935,552,211	0.89
内	イタリア	2,260,546,546	0.68
内	デンマーク	2,099,068,939	0.63
内	ジャージー	1,573,233,642	0.47
内	フィンランド	1,476,870,110	0.45
内	シンガポール	1,455,139,805	0.44
内	バミューダ	1,251,552,303	0.38
内	ベルギー	1,203,868,644	0.36
内	ノルウェー	905,644,187	0.27
内	ケイマン諸島	806,295,834	0.24
内	イスラエル	643,285,421	0.19
内	オランダ領キュラソー	580,300,569	0.18
内	ルクセンブルグ	360,552,037	0.11
内	オーストリア	292,238,953	0.09
内	ニュージーランド	255,216,691	0.08
内	パナマ	244,273,341	0.07
内	リベリア	178,865,850	0.05
内	ポルトガル	172,653,577	0.05
内	パプアニューギニア	84,414,258	0.03
内	イギリス領バージン諸島	60,325,690	0.02
内	マン島	54,071,222	0.02
内	モーリシャス	13,195,441	0.00
投資信託受益証券		787,198,372	0.24
内	オーストラリア	648,051,300	0.20
内	シンガポール	139,147,072	0.04
投資証券		7,538,654,636	2.27
内	アメリカ	6,673,189,352	2.01
内	イギリス	237,713,836	0.07
内	オランダ	231,214,639	0.07
内	香港	178,996,448	0.05
内	フランス	170,791,606	0.05
内	カナダ	46,748,755	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,445,773,103	1.64
純資産総額		331,503,884,274	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年11月30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）	150,200,770	0.05
-	150,200,770	0.05
為替予約取引（売建）	1,495,673,290	0.45
-	1,495,673,290	0.45
株価指数先物取引（買建）	3,371,451,298	1.02
内 アメリカ	2,350,994,858	0.71
内 ドイツ	561,413,231	0.17
内 イギリス	214,930,921	0.06
内 カナダ	124,767,868	0.04
内 オーストラリア	119,344,420	0.04

（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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	193,630,861,537	97.54
内 アメリカ	89,440,758,090	45.06
内 フランス	19,539,209,578	9.84
内 イタリア	17,272,730,606	8.70
内 ドイツ	12,957,087,296	6.53
内 イギリス	12,608,511,347	6.35
内 スペイン	11,713,849,762	5.90
内 ベルギー	4,830,901,057	2.43
内 オランダ	4,152,741,578	2.09
内 オーストラリア	3,980,048,400	2.01
内 カナダ	3,851,521,637	1.94
内 オーストリア	3,008,071,617	1.52
内 アイルランド	1,499,965,914	0.76
内 メキシコ	1,430,410,560	0.72
内 フィンランド	1,248,384,602	0.63
内 南アフリカ	1,183,305,870	0.60
内 ポーランド	1,147,481,785	0.58
内 デンマーク	1,075,621,514	0.54
内 マレーシア	902,008,301	0.45
内 シンガポール	758,924,308	0.38
内 スウェーデン	655,025,648	0.33
内 ノルウェー	374,302,067	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,875,174,421	2.46
純資産総額	198,506,035,958	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	418,435,978	0.21
-	418,435,978	0.21

（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。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	4,073,353,078	10.31
内 オーストラリア	2,745,605,910	6.95
内 シンガポール	1,310,833,393	3.32
内 カナダ	16,913,775	0.04
投資証券	35,204,055,403	89.11
内 アメリカ	28,685,479,293	72.61
内 イギリス	1,924,912,915	4.87
内 オランダ	987,261,816	2.50
内 フランス	878,409,179	2.22
内 香港	830,421,670	2.10
内 カナダ	699,147,504	1.77
内 ベルギー	306,525,061	0.78
内 スペイン	290,612,654	0.74
内 ニュージーランド	175,325,505	0.44
内 ドイツ	104,625,808	0.26
内 アイルランド	94,048,122	0.24
内 シンガポール	87,035,826	0.22
内 ガーンジー	53,573,948	0.14
内 イタリア	41,426,886	0.10
内 イスラエル	22,731,739	0.06
内 マン島	22,517,477	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	229,461,639	0.58
純資産総額	39,506,870,120	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年11月30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）	3,314,400	0.01
-	3,314,400	0.01

（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。

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成30年11月30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	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	88,005,645	1.2821 112,840,838	1.2876 113,316,068	- -	26.62%
2	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	30,305,396	3.5511 107,620,522	3.4935 105,871,900	- -	24.87%
3	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	41,166,801	2.5766 106,074,496	2.5703 105,811,028	- -	24.86%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	22,700,841	1.8094 41,074,902	1.8179 41,267,858	- -	9.69%
5	外国リート・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	22,970,248	1.2489 28,687,543	1.2478 28,662,275	- -	6.73%
6	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	13,957,155	1.8997 26,515,803	1.9377 27,044,779	- -	6.35%

(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11月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.13%
合計	99.13%

(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)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年11月30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	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,282,900	7,335.10 9,410,209,145	6,803.00 8,727,568,700	- -	3.12%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,907,500	782.12 6,184,658,820	624.50 4,938,233,750	- -	1.77%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	771,700	5,449.30 4,205,232,422	5,937.00 4,581,582,900	- -	1.64%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	472,100	8,700.09 4,107,313,931	9,526.00 4,497,224,600	- -	1.61%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	772,600	4,987.62 3,853,436,532	4,680.00 3,615,768,000	- -	1.29%
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,500	63,592.29 3,592,964,940	61,600.00 3,480,400,000	- -	1.25%
7	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	800,300	4,778.79 3,824,467,079	4,183.00 3,347,654,900	- -	1.20%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	971,200	3,820.07 3,710,054,235	3,202.00 3,109,782,400	- -	1.11%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	15,428,600	199.05 3,071,211,246	188.30 2,905,205,380	- -	1.04%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	995,500	2,682.23 2,670,160,955	2,664.00 2,652,012,000	- -	0.95%
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	788,000	2,502.18 1,971,723,884	3,123.00 2,460,924,000	- -	0.88%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	70,900	44,427.45 3,149,906,868	34,610.00 2,453,849,000	- -	0.88%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	795,600	2,968.99 2,362,134,471	3,062.00 2,436,127,200	- -	0.87%
14	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	103,100	20,305.69 2,093,517,207	23,325.00 2,404,807,500	- -	0.86%
15	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	475,300	4,476.80 2,127,824,368	4,943.00 2,349,407,900	- -	0.84%
16	花王 日本	株式 化学	279,500	7,706.03 2,153,835,659	8,358.00 2,336,061,000	- -	0.84%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	411,600	4,968.97 2,045,230,107	5,605.00 2,307,018,000	- -	0.83%
18	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	811,100	2,676.67 2,171,047,953	2,628.50 2,131,976,350	- -	0.76%
19	ファナック 日本	株式 電気機器	109,400	26,725.90 2,923,813,630	19,390.00 2,121,266,000	- -	0.76%
20	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	204,700	10,404.50 2,129,802,515	10,320.00 2,112,504,000	- -	0.76%

21	日本電産 日本	株式 電気機器	138,500	16,140.23 2,235,422,488	15,120.00 2,094,120,000	- -	0.75%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	120,800	15,312.32 1,849,728,581	17,315.00 2,091,652,000	- -	0.75%
23	信越化学工業 日本	株式 化学	198,700	11,419.69 2,269,094,042	10,135.00 2,013,824,500	- -	0.72%
24	キヤノン 日本	株式 電気機器	619,800	4,011.23 2,486,161,024	3,220.00 1,995,756,000	- -	0.71%
25	ダイキン工業 日本	株式 機械	157,100	12,279.69 1,929,139,782	12,610.00 1,981,031,000	- -	0.71%
26	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	454,500	5,812.96 2,641,991,286	4,255.00 1,933,897,500	- -	0.69%
27	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	667,200	3,267.77 2,180,260,587	2,823.50 1,883,839,200	- -	0.67%
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,061,400	1,478.49 1,569,275,928	1,744.50 1,851,612,300	- -	0.66%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,151,100	1,834.56 2,111,773,266	1,498.00 1,724,347,800	- -	0.62%
30	日立製作所 日本	株式 電気機器	518,300	4,042.44 2,095,200,230	3,288.00 1,704,170,400	- -	0.61%

(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11月30日現在

種類	投資比率
株式	97.20%
合計	97.20%

(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11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.64%
輸送用機器		7.82%
情報・通信業		7.34%
化学		7.13%
銀行業		6.52%
小売業		5.14%
医薬品		5.08%
機械		4.92%
卸売業		4.83%
サービス業		4.71%
陸運業		4.47%
食料品		4.26%
建設業		2.89%
保険業		2.34%
不動産業		2.32%
その他製品		2.03%
電気・ガス業		1.84%
精密機器		1.79%
その他金融業		1.17%
鉄鋼		0.98%
証券、商品先物取引業		0.90%
ガラス・土石製品		0.89%
ゴム製品		0.80%
非鉄金属		0.78%
石油・石炭製品		0.73%
繊維製品		0.65%
空運業		0.58%
金属製品		0.58%
鋳業		0.31%
パルプ・紙		0.28%
倉庫・運輸関連業	0.19%	
海運業	0.16%	
水産・農林業	0.12%	
合計		97.20%

(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。



## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30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	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	100.53 3,418,236,500	100.46 3,415,708,000	0.100000 2028/3/20	0.99%
2	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.16 3,198,092,000	103.13 3,197,309,000	0.400000 2025/9/20	0.93%
3	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.17 3,198,423,500	103.09 3,195,790,000	0.400000 2025/6/20	0.92%
4	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.51 3,136,836,600	0.300000 2025/12/20	0.91%
5	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,950,000,000	103.40 3,050,506,000	103.43 3,051,421,000	0.500000 2024/9/20	0.88%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	101.09 3,032,910,000	0.100000 2026/3/20	0.88%
7	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	101.05 3,031,770,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
8	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.87 3,026,130,000	0.100000 2027/3/20	0.88%
9	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.70 3,021,090,000	0.100000 2021/12/20	0.87%
10	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.55 3,016,560,000	0.100000 2021/3/20	0.87%
11	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.44 3,013,230,000	0.100000 2020/9/20	0.87%
12	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.47 3,014,100,000	100.31 3,009,510,000	0.100000 2020/3/20	0.87%
13	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.42 3,012,632,000	100.25 3,007,530,000	0.100000 2019/12/20	0.87%
14	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	104.00 3,016,047,000	103.50 3,001,761,000	0.800000 2022/9/20	0.87%
15	347回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	100.51 2,914,810,000	100.76 2,922,272,000	0.100000 2027/6/20	0.85%

16	348回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.47 2,913,805,000	100.70 2,920,358,000	0.100000 2027/9/20	0.84%
17	338回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,750,000,000	103.02 2,833,235,500	103.00 2,832,582,500	0.400000 2025/3/20	0.82%
18	344回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	100.68 2,819,100,000	100.97 2,827,328,000	0.100000 2026/9/20	0.82%
19	351回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,740,000,000	99.97 2,739,208,400	100.28 2,747,781,600	0.100000 2028/6/20	0.80%
20	345回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.61 2,716,610,000	100.92 2,725,002,000	0.100000 2026/12/20	0.79%
21	349回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,610,000,000	100.45 2,621,796,700	100.58 2,625,294,600	0.100000 2027/12/20	0.76%
22	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.99 2,599,920,000	103.72 2,593,100,000	0.600000 2024/3/20	0.75%
23	332回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,460,000,000	103.80 2,553,553,300	103.57 2,547,969,600	0.600000 2023/12/20	0.74%
24	126回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.59 2,514,950,000	100.50 2,512,550,000	0.100000 2020/12/20	0.73%
25	133回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,460,000,000	100.89 2,481,984,000	100.85 2,481,106,800	0.100000 2022/9/20	0.72%
26	328回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,390,000,000	103.35 2,470,186,100	103.10 2,464,257,300	0.600000 2023/3/20	0.71%
27	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,350,000,000	104.04 2,445,131,000	103.87 2,441,039,000	0.600000 2024/6/20	0.71%
28	129回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,420,000,000	100.72 2,437,464,500	100.64 2,435,609,000	0.100000 2021/9/20	0.70%
29	329回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,270,000,000	104.73 2,377,375,100	104.18 2,364,886,000	0.800000 2023/6/20	0.68%
30	312回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,200,000,000	103.74 2,282,456,000	102.73 2,260,258,000	1.200000 2020/12/20	0.65%

（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11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	82.37%
地方債証券	6.34%
特殊債券	5.22%
社債券	4.35%
合計	98.28%

(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。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年11月30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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,364	632,356.44 2,127,247,082	707,000.00 2,378,348,000	- -	7.53%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,474	576,913.04 2,004,195,935	627,000.00 2,178,198,000	- -	6.89%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,298	152,381.50 1,569,224,777	151,600.00 1,561,176,800	- -	4.94%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,566	202,324.99 1,328,465,949	217,700.00 1,429,418,200	- -	4.52%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,663	171,965.85 1,317,774,325	180,700.00 1,384,704,100	- -	4.38%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,922	173,737.65 1,202,612,033	184,700.00 1,278,493,400	- -	4.05%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,350	258,871.34 1,126,090,367	257,300.00 1,119,255,000	- -	3.54%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,660	229,222.94 1,068,178,906	235,100.00 1,095,566,000	- -	3.47%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,386	287,249.05 972,625,317	313,500.00 1,061,511,000	- -	3.36%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	8,609	117,525.58 1,011,777,743	114,200.00 983,147,800	- -	3.11%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,199	402,878.37 885,929,551	443,500.00 975,256,500	- -	3.09%
12	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,075	683,672.30 734,947,724	745,000.00 800,875,000	- -	2.53%

13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	10,060	81,935.13 824,267,415	79,000.00 794,740,000	- -	2.52%
14	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,665	486,894.03 810,678,565	477,000.00 794,205,000	- -	2.51%
15	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,154	501,957.39 579,258,835	551,000.00 635,854,000	- -	2.01%
16	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,964	71,241.61 638,609,872	69,900.00 626,583,600	- -	1.98%
17	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,158	49,082.96 596,750,682	47,100.00 572,641,800	- -	1.81%
18	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	802	658,222.37 527,894,344	702,000.00 563,004,000	- -	1.78%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,985	139,381.45 555,435,113	140,600.00 560,291,000	- -	1.77%
20	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,182	449,207.54 530,963,315	441,500.00 521,853,000	- -	1.65%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,292	223,882.51 513,138,725	226,600.00 519,367,200	- -	1.64%
22	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,111	144,898.84 450,780,299	155,600.00 484,071,600	- -	1.53%
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,809	166,700.03 468,260,392	166,000.00 466,294,000	- -	1.48%
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,566	122,990.90 438,585,573	126,900.00 452,525,400	- -	1.43%
25	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,048	118,850.61 481,107,282	111,000.00 449,328,000	- -	1.42%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,121	339,608.61 380,701,253	371,500.00 416,451,500	- -	1.32%
27	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,483	160,916.28 399,555,133	164,600.00 408,701,800	- -	1.29%
28	プレミアム投資法人 日本	投資証券	3,303	109,849.67 362,833,469	122,900.00 405,938,700	- -	1.28%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,329	151,654.01 353,202,191	167,300.00 389,641,700	- -	1.23%
30	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,325	264,039.72 349,852,634	284,700.00 377,227,500	- -	1.19%

(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11月30日現在

種類	投資比率
投資証券	97.32%
合計	97.32%

（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。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30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	398,277	19,458.64 7,749,929,247	20,373.53 8,114,311,793	- -	2.45%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	591,025	10,490.45 6,200,122,646	12,503.25 7,389,738,827	- -	2.23%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	33,435	168,142.36 5,621,840,038	189,899.98 6,349,306,095	- -	1.92%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	217,173	14,836.61 3,222,112,367	16,549.59 3,594,126,172	- -	1.08%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	275,151	12,999.21 3,576,746,353	12,488.50 3,436,225,519	- -	1.04%
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	25,453	121,658.44 3,096,572,479	123,489.40 3,143,175,723	- -	0.95%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	342,659	8,707.77 2,983,798,938	8,970.93 3,073,972,712	- -	0.93%
8	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	194,641	20,078.06 3,908,014,276	15,736.01 3,062,874,590	- -	0.92%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	24,209	122,119.04 2,956,380,004	124,201.99 3,006,806,038	- -	0.91%
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	103,466	22,876.69 2,366,960,186	24,702.41 2,555,860,484	- -	0.77%
11	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	77,838	26,349.98 2,051,029,846	32,060.94 2,495,560,109	- -	0.75%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	779,252	3,595.26 2,801,618,659	3,181.69 2,479,345,153	- -	0.75%
13	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	473,775	4,084.87 1,935,309,528	5,164.01 2,446,583,433	- -	0.74%

14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	251,407	8,863.11 2,228,249,417	9,704.27 2,439,723,921	- -	0.74%
15	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	374,611	6,687.56 2,505,235,876	6,131.91 2,297,084,233	- -	0.69%
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	144,332	13,891.32 2,004,962,144	15,783.67 2,278,089,668	- -	0.69%
17	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	334,688	5,683.36 1,902,153,380	6,745.79 2,257,735,465	- -	0.68%
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	203,795	9,249.42 1,884,986,394	10,532.28 2,146,427,103	- -	0.65%
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	154,746	12,907.37 1,997,364,210	13,485.90 2,086,890,551	- -	0.63%
20	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	380,766	4,823.12 1,836,482,054	5,371.66 2,045,349,223	- -	0.62%
21	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	377,745	5,178.57 1,956,180,563	5,412.51 2,044,551,989	- -	0.62%
22	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	588,509	3,946.25 2,322,406,682	3,468.77 2,041,407,013	- -	0.62%
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	217,964	6,381.70 1,390,981,051	8,840.44 1,926,899,342	- -	0.58%
24	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	93,569	20,933.54 1,958,731,010	19,932.14 1,865,030,426	- -	0.56%
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	325,562	5,038.56 1,640,366,678	5,557.76 1,809,395,656	- -	0.55%
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	175,788	9,112.75 1,601,912,251	10,292.00 1,809,210,799	- -	0.55%
27	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	44,865	39,428.32 1,768,952,001	38,870.28 1,743,915,255	- -	0.53%
28	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	75,044	19,882.79 1,492,084,708	22,315.01 1,674,607,625	- -	0.51%
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	373,074	4,443.58 1,657,786,496	4,472.98 1,668,755,301	- -	0.50%
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	56,955	25,530.61 1,454,096,378	28,953.37 1,649,039,757	- -	0.50%

(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11月30日現在

種類	投資比率
株式	95.85%
投資信託受益証券	0.24%
投資証券	2.27%
合計	98.36%

（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11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.55%
石油・ガス・消耗燃料		6.04%
医薬品		5.88%
ソフトウェア		4.63%
保険		3.78%
情報技術サービス		3.56%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		2.93%
資本市場		2.82%
半導体・半導体製造装置		2.76%
コンピュータ・周辺機器		2.75%
ヘルスケア機器・用品		2.53%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.40%
インターネット販売・通信販売		2.37%
化学		2.34%
各種電気通信サービス		2.19%
航空宇宙・防衛		2.17%
バイオテクノロジー		2.12%
飲料		1.95%
食品		1.88%
ホテル・レストラン・レジャー		1.88%
電力		1.87%
専門小売り		1.59%
食品・生活必需品小売り		1.56%
機械		1.50%
娯楽		1.42%
コングロマリット		1.39%
金属・鉱業		1.34%
家庭用品		1.29%
繊維・アパレル・贅沢品		1.26%
メディア		1.24%
陸運・鉄道		1.06%
総合公益事業		1.05%
各種金融サービス		1.02%
タバコ		1.00%
通信機器		0.98%
自動車		0.90%
電気設備		0.74%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.73%



パーソナル用品	0.72%
専門サービス	0.65%
航空貨物・物流サービス	0.58%
不動産管理・開発	0.51%
消費者金融	0.50%
複合小売り	0.49%
電子装置・機器・部品	0.47%
商業サービス・用品	0.44%
エネルギー設備・サービス	0.40%
建設関連製品	0.37%
家庭用耐久財	0.36%
自動車部品	0.34%
無線通信サービス	0.33%
建設・土木	0.32%
商社・流通業	0.29%
容器・包装	0.28%
建設資材	0.27%
運送インフラ	0.19%
ガス	0.17%
旅客航空輸送業	0.13%
紙製品・林産品	0.09%
水道	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07%
販売	0.07%
海運業	0.07%
レジャー用品	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	95.85%

(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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30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	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,872,255,000	100.65 1,884,462,102	99.69 1,866,619,512	2.625000 2020/8/15	0.94%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,736,091,000	102.61 1,781,524,501	100.98 1,753,243,579	3.625000 2020/2/15	0.88%
3	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,702,050,000	98.41 1,675,055,487	98.69 1,679,906,329	1.250000 2019/10/31	0.85%
4	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,588,580,000	102.59 1,629,771,879	101.00 1,604,465,800	3.500000 2020/5/15	0.81%
5	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,361,640,000	98.01 1,334,611,446	98.03 1,334,829,308	1.375000 2020/4/30	0.67%
6	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,361,640,000	98.51 1,341,365,180	98.01 1,334,556,980	2.000000 2021/5/31	0.67%
7	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証券	1,361,640,000	96.83 1,318,544,094	96.51 1,314,186,846	1.875000 2022/8/31	0.66%
8	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,327,599,000	98.43 1,306,848,627	97.86 1,299,281,313	2.125000 2021/12/31	0.65%
9	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,331,003,100	97.89 1,303,025,414	97.45 1,297,102,451	2.000000 2022/2/15	0.65%
10	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,304,905,000	99.41 1,297,258,256	98.70 1,288,071,725	2.250000 2021/3/31	0.65%
11	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,327,599,000	96.79 1,285,062,728	96.54 1,281,743,730	1.750000 2022/3/31	0.65%
12	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,316,252,000	96.67 1,272,539,271	96.40 1,268,945,903	1.750000 2022/5/15	0.64%
13	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,248,170,000	98.95 1,235,151,586	98.55 1,230,171,388	1.875000 2020/6/30	0.62%
14	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,271,998,700	96.34 1,225,527,855	96.63 1,229,259,543	1.375000 2021/4/30	0.62%
15	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,248,170,000	98.74 1,232,468,021	98.16 1,225,253,598	2.125000 2021/8/15	0.62%
16	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,225,476,000	98.10 1,202,204,210	98.27 1,204,361,048	1.250000 2020/1/31	0.61%
17	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,253,843,500	95.67 1,199,668,106	95.40 1,196,191,775	1.625000 2022/11/15	0.60%
18	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	1,191,435,000	98.96 1,179,044,076	98.41 1,172,538,840	2.000000 2020/11/30	0.59%
19	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,180,088,000	98.12 1,157,996,752	97.67 1,152,603,750	2.000000 2021/11/15	0.58%
20	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,134,700,000	100.15 1,136,470,132	99.46 1,128,663,396	2.750000 2023/11/15	0.57%
21	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,160,798,100	96.20 1,116,803,852	95.98 1,114,180,448	1.750000 2022/9/30	0.56%
22	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,134,700,000	98.62 1,119,097,875	98.08 1,112,970,495	2.125000 2021/9/30	0.56%
23	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	1,134,700,000	95.85 1,087,690,888	95.63 1,085,136,304	1.750000 2023/1/31	0.55%

24	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,007,682,000	107.59 1,084,205,371	105.83 1,066,510,475	2.500000 2020/10/25	0.54%
25	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,077,965,000	98.05 1,056,987,801	97.51 1,051,177,569	2.125000 2022/6/30	0.53%
26	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,049,597,500	99.65 1,045,997,380	99.67 1,046,186,308	2.625000 2020/8/31	0.53%
27	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,077,965,000	96.94 1,045,076,287	96.57 1,041,077,037	2.000000 2023/2/15	0.52%
28	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,077,965,000	95.83 1,033,110,876	95.67 1,031,386,132	1.625000 2022/8/15	0.52%
29	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,077,965,000	94.74 1,021,371,837	94.71 1,021,026,888	2.000000 2025/2/15	0.51%
30	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,021,230,000	98.42 1,005,104,778	98.02 1,001,040,282	2.500000 2024/5/15	0.50%

(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11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	97.54%
合計	97.54%

(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。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	94,813	19,832.17 1,880,347,889	20,946.56 1,986,006,382	- -	5.03%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	193,062	7,361.06 1,421,141,501	7,622.91 1,471,695,138	- -	3.73%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	45,966	24,590.39 1,130,322,159	24,039.75 1,105,011,341	- -	2.80%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	114,140	7,049.47 804,627,507	8,105.16 925,123,202	- -	2.34%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	42,407	19,744.47 837,304,024	21,340.30 904,978,225	- -	2.29%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	112,993	7,299.54 824,797,802	7,973.53 900,953,854	- -	2.28%
7	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	42,231	23,302.30 984,079,494	19,980.52 843,797,568	- -	2.14%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	63,241	12,459.26 787,936,499	12,900.40 815,834,468	- -	2.07%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	109,380	6,413.73 701,534,830	7,086.20 775,088,720	- -	1.96%
10	LINK REIT 香港	投資証券	652,020	1,033.67 673,977,122	1,094.77 713,818,129	- -	1.81%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	47,394	13,964.83 661,849,463	14,730.67 698,145,629	- -	1.77%
12	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	89,027	6,380.05 567,997,237	7,246.19 645,106,931	- -	1.63%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	20,276	27,251.85 552,558,579	29,427.30 596,668,133	- -	1.51%
14	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,634,735	353.10 577,232,248	333.15 544,613,273	- -	1.38%
15	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	227,754	2,362.07 537,972,154	2,189.97 498,774,655	- -	1.26%
16	HCP INC アメリカ	投資証券	144,291	2,931.63 423,009,110	3,267.93 471,533,753	- -	1.19%
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	32,482	14,244.80 462,699,865	13,886.45 451,059,948	- -	1.14%
18	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	490,480	839.94 411,978,168	887.29 435,200,157	- -	1.10%
19	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	53,180	8,210.19 436,618,269	8,008.71 425,903,336	- -	1.08%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	38,862	10,918.49 424,314,534	10,710.43 416,228,858	- -	1.05%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	34,965	11,281.61 394,461,710	11,598.90 405,555,657	- -	1.03%
22	UDR INC アメリカ	投資証券	82,241	4,321.10 355,371,678	4,753.25 390,912,715	- -	0.99%

23	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	49,328	7,552.15 372,532,914	7,692.13 379,437,452	- -	0.96%
24	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	51,663	7,132.61 368,492,490	7,128.18 368,263,442	- -	0.93%
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	108,919	3,242.04 353,119,891	3,185.10 346,918,222	- -	0.88%
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	87,215	3,887.47 339,045,894	3,829.61 333,999,654	- -	0.85%
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	22,401	14,185.46 317,768,664	14,852.08 332,701,630	- -	0.84%
28	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	26,315	11,181.45 294,239,943	11,664.71 306,957,001	- -	0.78%
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	28,280	10,439.70 295,234,963	10,634.40 300,741,069	- -	0.76%
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	27,151	10,554.36 286,561,662	11,053.11 300,103,062	- -	0.76%

(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11月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.31%
投資証券	89.11%
合計	99.42%

(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。

#### 【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)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年11月30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
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 3012月	買建	458	7,516,633,392	7,639,440,000	2.73%

(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。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年11月30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
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 3012月	買建	351	607,969,908	637,767,000	2.02%

(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。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30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12月	買建	1,076,000	122,233,600	122,050,680	0.04%
		ユーロ買/円売201 8年12月	買建	115,000	14,847,190	14,855,700	0.00%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年12月	買建	47,000	6,848,041	6,814,530	0.00%
		オーストラリア・ドル 買/円売2018年1 2月	買建	41,000	3,399,105	3,405,460	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2018年12月	買建	36,000	3,078,576	3,074,400	0.00%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年12月	売建	9,363,000	1,062,045,090	1,061,951,460	0.32%
		ユーロ売/円買201 8年12月	売建	1,924,000	248,530,776	248,542,320	0.07%
		イギリス・ポンド売/ 円買2018年12月	売建	649,000	94,095,914	94,092,020	0.03%
		カナダ・ドル売/円買 2018年12月	売建	631,000	53,886,138	53,881,090	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2018年1 2月	売建	448,000	37,213,120	37,206,400	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Dec 18	買建	151	2,339,497,510	2,350,994,858	0.71%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Dec 18	買建	137	567,040,748	561,413,231	0.17%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Dec 18	買建	21	214,827,239	214,930,921	0.06%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT D ec 18	買建	8	122,962,090	124,767,868	0.04%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Dec 1 8	買建	10	120,943,710	119,344,420	0.04%

(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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30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・ドル売/円 買 2018年12月	売建	3,148,108	357,090,000	357,058,519	0.18%
		イギリス・ポンド売/ 円買 2018年12月	売建	423,351	61,380,000	61,377,459	0.03%

(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) 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。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30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	-	シンガポール・ドル 買/円売 2018年1 2月	買建	40,000	3,302,252	3,314,400	0.01%

(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) 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11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5特定期間末 (平成21年5月11日)	972	976	0.6435	0.6460
第6特定期間末 (平成21年11月11日)	966	970	0.6528	0.6553
第7特定期間末 (平成22年5月11日)	927	930	0.6634	0.6659
第8特定期間末 (平成22年11月11日)	861	863	0.6399	0.6414
第9特定期間末 (平成23年5月11日)	823	825	0.6487	0.6502
第10特定期間末 (平成23年11月11日)	712	714	0.5956	0.5971
第11特定期間末 (平成24年5月11日)	692	694	0.6202	0.6217
第12特定期間末 (平成24年11月12日)	652	653	0.6218	0.6233
第13特定期間末 (平成25年5月13日)	824	825	0.8225	0.8240
第14特定期間末 (平成25年11月11日)	736	738	0.8118	0.8133
第15特定期間末 (平成26年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末 (平成26年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383
第17特定期間末 (平成27年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末 (平成27年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末 (平成28年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369
第20特定期間末 (平成28年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220
第21特定期間末 (平成29年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (平成29年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585
第23特定期間末 (平成30年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
第24特定期間末 (平成30年11月12日)	428	428	1.0434	1.0449
平成29年11月末日	471	-	1.0596	-

12月末日	465	-	1.0744	-
平成30年1月末日	461	-	1.0731	-
2月末日	446	-	1.0422	-
3月末日	436	-	1.0236	-
4月末日	446	-	1.0476	-
5月末日	441	-	1.0430	-
6月末日	446	-	1.0474	-
7月末日	451	-	1.0592	-
8月末日	450	-	1.0619	-
9月末日	449	-	1.0824	-
10月末日	421	-	1.0274	-
11月末日	425	-	1.0410	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第5特定期間	0.0075
第6特定期間	0.0075
第7特定期間	0.0075
第8特定期間	0.0065
第9特定期間	0.0045
第10特定期間	0.0045
第11特定期間	0.0045
第12特定期間	0.0045
第13特定期間	0.0045
第14特定期間	0.0045
第15特定期間	0.0045
第16特定期間	0.0045
第17特定期間	0.0045
第18特定期間	0.0045
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0045
第21特定期間	0.0045
第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第5特定期間	4.7
第6特定期間	2.6
第7特定期間	2.8
第8特定期間	2.6
第9特定期間	2.1
第10特定期間	7.5
第11特定期間	4.9
第12特定期間	1.0
第13特定期間	33.0
第14特定期間	0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	1.0
第19特定期間	5.5
第20特定期間	1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	0.8

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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5特定期間	21,260,000	61,570,000
第6特定期間	31,970,000	63,550,000
第7特定期間	16,430,000	99,520,000
第8特定期間	12,120,000	62,800,000
第9特定期間	21,210,000	98,740,000
第10特定期間	7,120,000	79,920,000
第11特定期間	10,800,000	90,460,000
第12特定期間	3,810,000	71,430,000
第13特定期間	22,800,000	69,530,000
第14特定期間	13,700,000	108,500,000
第15特定期間	52,399,738	112,932,769
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662

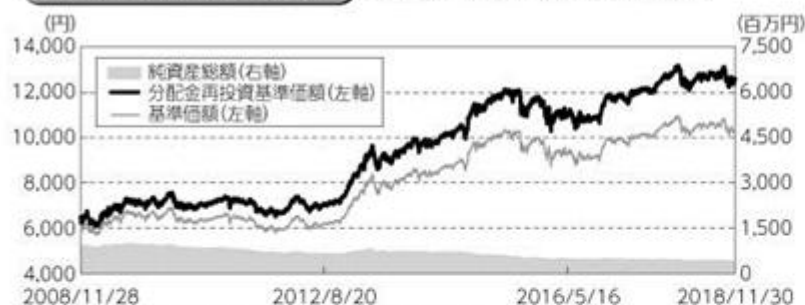
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2018年11月30日

## 基準価額・純資産の推移

(2008年11月28日～2018年11月30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:2007年1月26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66期	(2018.03.12)	15円
第67期	(2018.05.11)	15円
第68期	(2018.07.11)	15円
第69期	(2018.09.11)	15円
第70期	(2018.11.12)	15円
直近1年間累計		90円
設定来累計		1,560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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.62%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	24.87%
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	24.86%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.69%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.73%
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.35%

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・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。

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.12%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.77%
3	ソニー	株式	日本	電気機器	1.64%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.61%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.29%

## ■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。

## 組入上位5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	2.45%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.23%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.92%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.08%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.04%

○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。

データの基準日: 2018年11月30日

## 主要な資産の状況

### ■国内債券パッシブ・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。

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	0.99%
2	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	0.93%
3	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.92%
4	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.91%
5	335回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.500000	2024/9/20	0.88%

### ■外国債券パッシブ・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。

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.94%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.88%
3	US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	アメリカ	1.250000	2019/10/31	0.85%
4	US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	アメリカ	3.500000	2020/5/15	0.81%
5	US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/4/30	0.67%

### ■J-REITインデックスファンド・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。

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	7.53%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.89%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.94%
4	日本リートファンド投資法人	投資証券	日本	4.52%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.38%

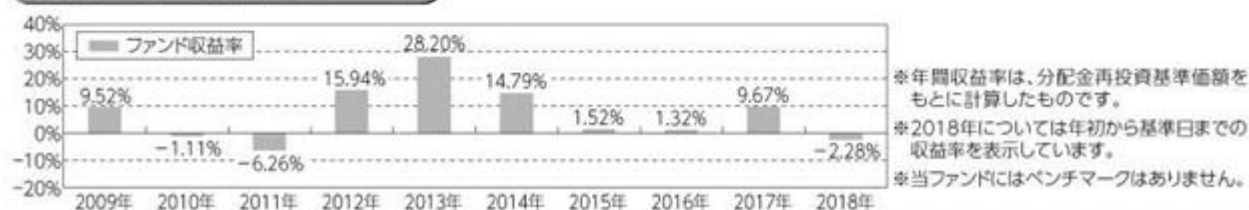
### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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。

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	5.03%
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	3.73%
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.80%
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.34%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	アメリカ	2.29%

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



○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

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、Frankfurtの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれか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。)には、お申込みの受付は行いません。

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係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。受託会社は、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。

「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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。)

#### ・お申込手数料

ありません。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 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】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。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。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後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解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該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。なお、解約の請求を受益者がするとき、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、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から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

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および借入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
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
不動産投資信託証券	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】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は2007年1月26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奇数月の12日から翌奇数月の11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、信託財産の純資産総額が10億円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、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.から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、その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」の規定に従い、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出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、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異議を述べる旨を付記します。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. の規定に従います。
- 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。

#### ハ. 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ヵ月前までに、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。

当ファンドの投資顧問契約について、委託会社とイボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社(投資顧問会社)との間の当該契約は、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。

#### ニ. 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5月11日、11月11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

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5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。

収益分配金は、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てします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

##### 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します。)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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 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、当特定期間(平成30年5月12日から平成30年11月12日まで)の財務諸表について、EY新日本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】

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;隔月分配型&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前 期 平成30年5月11日現在	当 期 平成30年11月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,952,108	4,611,558
親投資信託受益証券	447,488,569	424,657,026
流動資産合計	452,440,677	429,268,584
資産合計	452,440,677	429,268,584
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	637,420	615,406
未払解約金	2,112,108	-
未払受託者報酬	54,768	43,779
未払委託者報酬	688,628	533,280
その他未払費用	3,093	3,041
流動負債合計	3,496,017	1,195,506
負債合計	3,496,017	1,195,506
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,424,946,815	1,410,270,902
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	23,997,845	17,802,176
(分配準備積立金)	57,279,208	55,026,772
元本等合計	448,944,660	428,073,078
純資産合計	448,944,660	428,073,078
負債純資産合計	452,440,677	429,268,584

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日	当 期 自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	4,010,920	1,255,543
その他収益	1,949	2,612
営業収益合計	4,012,869	1,252,931
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,169	3,003
受託者報酬	168,482	158,140
委託者報酬	2,118,612	1,971,325
その他費用	9,543	9,518
営業費用合計	2,298,806	2,141,986
営業利益又は営業損失（ ）	1,714,063	3,394,917
経常利益又は経常損失（ ）	1,714,063	3,394,917
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,714,063	3,394,917
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（ ）	113,958	132,162
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	25,739,986	23,997,845
剰余金増加額又は欠損金減少額	228,459	346,418
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	228,459	346,418
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,871,080	1,128,501
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,871,080	1,128,501
分配金	1,927,541	1,886,507
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,997,845	17,802,176

## (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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年5月11日及び11月11日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を平成30年11月12日としております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	前 期 平成30年5月11日現在	当 期 平成30年11月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	451,853,385円 4,576,025円 31,482,595円	424,946,815円 6,951,749円 21,627,662円
2. 受益権の総数	424,946,815口	410,270,902口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日	当 期 自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12日
1. 1 分配金の計算過程	(自平成29年11月14日 至平成30年1月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,191,380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(10,458,239円)、信託約款に規定される収益調整金(6,412,938円)及び分配準備積立金(46,574,750円)より分配対象収益は64,637,307円(1万口当たり1,495.56円)であり、うち648,290円(1万口当たり15円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)	(自平成30年5月12日 至平成30年7月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(633,348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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(7,572,463円)及び分配準備積立金(56,794,899円)より分配対象収益は65,000,710円(1万口当たり1,522.40円)であり、うち640,441円(1万口当たり15円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)



<p>(自平成30年1月12日 至平成30年3月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(329,450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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,633,735円)及び分配準備積立金(56,719,442円)より分配対象収益は63,682,627円(1万口当たり1,488.30円)であり、うち641,831円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成30年3月13日 至平成30年5月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,089,516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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,781,976円)及び分配準備積立金(55,827,112円)より分配対象収益は64,698,604円(1万口当たり1,522.51円)であり、うち637,420円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年7月12日 至平成30年9月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(580,862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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(7,538,216円)及び分配準備積立金(55,839,830円)より分配対象収益は63,958,908円(1万口当たり1,521.24円)であり、うち630,660円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成30年9月12日 至平成30年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,295,803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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(7,450,336円)及び分配準備積立金(54,346,375円)より分配対象収益は63,092,514円(1万口当たり1,537.83円)であり、うち615,406円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
---	--

## (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	前 期 自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日	当 期 自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12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	前 期 平成30年5月11日現在	当 期 平成30年11月12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	前期 平成30年5月11日現在	当期 平成30年11月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	10,203,144	1,684,287
合計	10,203,144	1,684,287

（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）

	前期 平成30年5月11日現在	当期 平成30年11月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0565円 (10,565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11月12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	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	41,354,593	106,558,379	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	88,374,891	113,314,285	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	14,015,062	26,625,814	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	30,441,363	108,103,368	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22,797,155	41,249,172	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	23,065,104	28,806,008	
親投資信託受益証券 合計		220,048,168	424,657,026	
合計		220,048,168	424,657,026	

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、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・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。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,558,479,567	5,155,250,321
株式	2	301,312,473,020	272,635,488,350
派生商品評価勘定		189,609,700	125,473,720
未収入金		1,064,352	2,490,000
未収配当金		2,735,872,149	2,490,276,626
流動資産合計		307,797,498,788	280,408,979,017
資産合計		307,797,498,788	280,408,979,017
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	36,093,260
前受金		138,615,000	96,415,000
未払解約金		438,619,000	100,079,000
流動負債合計		577,234,000	232,587,260
負債合計		577,234,000	232,587,260
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,182,048,425	108,734,086,652
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		195,038,216,363	171,442,305,105
元本等合計		307,220,264,788	280,176,391,757
純資産合計		307,220,264,788	280,176,391,757
負債純資産合計		307,797,498,788	280,408,979,017

## 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	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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3. 収益及び費用の計上基準	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。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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	116,418,560,169円	112,182,048,425円
同期中追加設定元本額	13,486,063,682円	18,299,049,099円
同期中一部解約元本額	17,722,575,426円	21,747,010,872円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	9,657,902,450円	11,697,020,513円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,965,437,104円	2,636,340,260円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,825,859円	3,392,166円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	8,909,366円	7,271,489円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	15,123,068円	12,819,569円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	23,066,842円	23,465,281円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	18,934,862円	19,553,564円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	15,039,866円	15,762,405円
たわらノーロード TOPIX	187,878,652円	329,917,368円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	23,722,900円	71,295,544円
たわらノーロード バランス（堅実型）	556,113円	1,824,425円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,468,740円	13,158,737円
たわらノーロード バランス（積極型）	10,271,455円	30,484,387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）	58,648円	207,028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）	2,302,843円	7,013,112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）	4,748,704円	24,379,741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)	3,145,468円	18,546,921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)	8,434,606円	45,453,081円
たわらノーロード 最適化バランス(保 守型)	41,292円	45,290円
たわらノーロード 最適化バランス(安 定型)	59,943円	81,801円
たわらノーロード 最適化バランス(安 定成長型)	405,305円	802,595円
たわらノーロード 最適化バランス(成 長型)	438,090円	594,633円
たわらノーロード 最適化バランス(積 極型)	1,295,960円	1,996,341円
D I A M国内株式インデックスファンド < D C年金>	37,330,513,771円	38,157,146,657円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型	783,614,103円	866,672,184円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型	2,743,165,976円	2,921,011,264円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型	2,861,320,138円	3,056,587,421円
D I A M D C バランス30インデッ クスファンド	332,719,355円	343,429,890円
D I A M D C バランス50インデッ クスファンド	1,126,397,139円	1,146,466,084円
D I A M D C バランス70インデッ クスファンド	1,058,878,824円	1,093,778,761円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配 型>	43,373,703円	41,354,593円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,084,829,283円	1,084,339,387円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	25,558,900円	26,126,648円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	41,290,133円	278,344,409円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	107,171,507円	179,762,429円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	209,525,959円	314,461,765円
投資のソムリエ	2,487,274,484円	435,971,927円
クルーズコントロール	1,390,704,355円	842,058,816円
投資のソムリエ< D C年金>	180,556,941円	38,585,097円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	166,392,070円	198,688,170円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	220,096,858円	253,355,924円
クルーズコントロール< D C年金>	547,151円	564,859円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実 型)	7,534,669円	6,887,934円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極 型)	23,605,451円	19,416,091円
投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制 型	34,252,346円	23,826,329円



ダイナミック・ナビゲーション	1,941,778円	449,675円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	612,669,204円	436,641,186円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	718,845円	957,696円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	533,560円	698,794円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	164,969円	137,950円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	1,380,023円	1,294,784円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,810,802円	14,501,814円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	126,294,522円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	18,666円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	70,249,658円	67,427,854円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	-円	54,483,445円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	126,818,456円	114,888,153円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	289,627,075円	281,866,607円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	15,997,852円	15,210,643円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	70,553,486円	64,068,386円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	17,154,020円	16,333,666円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,390,655円	15,639,738円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,249,893円	30,068,459円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,224,133円	54,409,906円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,046,361,232円	1,031,544,058円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	991,925,273円	969,394,849円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,729,403,081円	2,699,937,775円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	195,748,564円	190,097,600円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	76,069,383円	52,061,278円
DIAM 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)	572,608,185円	556,287,813円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	1,105,386,217円	415,622,156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)	10,313,671円	10,313,671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)	14,110,884円	7,515,147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)	469,455,076円	54,862,660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)	14,963,847,137円	10,522,058,392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)	537,621,021円	318,492,171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)	1,704,844,971円	1,757,785,389円
	D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	9,813,096,875円	10,040,664,400円
	D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	4,723,516円	4,713,385円
	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	386,824円	283,368円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	3,682,782円	3,856,479円
	D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	8,737,439,675円	8,983,887,646円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	70,184,843円	70,355,143円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	27,636,505円	28,070,236円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	25,211,890円	25,624,221円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	97,482円	102,630円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	110,015円	115,943円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	426,902,115円	405,365,089円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,311,785,878円	1,261,532,817円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,737,262,933円	1,669,062,351円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	73,956,736円	68,825,151円
	計	112,182,048,425円	108,734,086,652円
2.	受益権の総数	112,182,048,425口	108,734,086,652口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,771,500,000円	株式 3,354,500,000円

## （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29年11月14日 至 平成30年5月11日	自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12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、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、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。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、株価の変動によるリスクを有しております。	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	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	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つた場合、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30年5月11日現在	平成30年11月12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	7,683,990,238	11,601,195,788
合計	7,683,990,238	11,601,195,788

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月8日から平成30年5月11日まで及び平成30年2月8日から平成30年11月12日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	平成30年5月11日 現在				平成30年11月12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	5,642,410,000	-	5,832,125,000	189,715,000	9,685,780,000	-	9,775,350,000	89,570,000
合計	5,642,410,000	-	5,832,125,000	189,715,000	9,685,780,000	-	9,775,350,000	89,570,000

## （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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	2.7386円	2.5767円
（1万口当たり純資産額）	（27,386円）	（25,767円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年11月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	3,160.00	16,116,000	
日本水産	156,300	712.00	111,285,600	
マルハニチロ	22,600	4,395.00	99,327,000	
ハウスイ	900	939.00	845,100	
カネコ種苗	4,300	1,455.00	6,256,500	
サカタのタネ	19,000	3,750.00	71,250,000	
ホクト	13,100	2,058.00	26,959,800	
ホクリヨウ	2,100	739.00	1,551,900	
ヒノキヤグループ	3,300	2,395.00	7,903,500	
ショーボンドホールディングス	12,200	8,220.00	100,284,000	
ミライト・ホールディングス	40,000	1,693.00	67,720,000	
タマホーム	9,700	1,161.00	11,261,700	
サンヨーホームズ	2,300	887.00	2,040,100	
日本アクア	3,800	352.00	1,337,600	
ファーストコーポレーション	4,300	1,113.00	4,785,900	
ベステラ	3,000	1,433.00	4,299,000	
TATERU	19,000	616.00	11,704,000	
スペースバリューホールディングス	19,100	1,053.00	20,112,300	
住石ホールディングス	33,700	120.00	4,044,000	
日鉄鉱業	3,600	5,210.00	18,756,000	
三井松島ホールディングス	6,500	1,567.00	10,185,500	
国際石油開発帝石	627,200	1,300.00	815,360,000	
石油資源開発	22,500	2,440.00	54,900,000	
K&Oエナジーグループ	7,600	1,591.00	12,091,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	860.00	2,580,000	
第一カッター興業	1,700	2,314.00	3,933,800	
安藤・間	99,900	693.00	69,230,700	
東急建設	45,800	1,120.00	51,296,000	
コムシスホールディングス	55,400	2,982.00	165,202,800	
ミサワホーム	12,300	812.00	9,987,600	
ピーアールホールディングス	12,900	411.00	5,301,900	
高松コンストラクショングループ	9,700	2,983.00	28,935,100	
東建コーポレーション	4,800	7,920.00	38,016,000	
ソネック	1,600	791.00	1,265,600	
ヤマウラ	6,100	889.00	5,422,900	
大成建設	128,400	5,040.00	647,136,000	
大林組	386,800	1,078.00	416,970,400	
清水建設	394,500	937.00	369,646,500	
飛島建設	11,000	1,758.00	19,338,000	
長谷工コーポレーション	161,200	1,405.00	226,486,000	
松井建設	14,300	859.00	12,283,700	
銭高組	1,600	5,440.00	8,704,000	
鹿島建設	302,300	1,545.00	467,053,500	

不動テトラ	9,800	1,873.00	18,355,400
大末建設	4,600	1,150.00	5,290,000
鉄建建設	7,800	2,919.00	22,768,200
西松建設	27,800	2,705.00	75,199,000
三井住友建設	93,000	720.00	66,960,000
大豊建設	8,700	3,515.00	30,580,500
前田建設工業	92,000	1,160.00	106,720,000
佐田建設	8,200	418.00	3,427,600
ナカノフドー建設	9,900	672.00	6,652,800
奥村組	21,200	3,630.00	76,956,000
東鉄工業	15,500	3,115.00	48,282,500
イチケン	2,400	2,206.00	5,294,400
富士ピー・エス	4,000	528.00	2,112,000
浅沼組	4,600	3,430.00	15,778,000
戸田建設	149,900	754.00	113,024,600
熊谷組	18,400	3,440.00	63,296,000
青木あすなろ建設	6,400	1,013.00	6,483,200
北野建設	2,700	3,960.00	10,692,000
植木組	1,600	2,439.00	3,902,400
矢作建設工業	17,600	786.00	13,833,600
ピーエス三菱	13,600	731.00	9,941,600
日本ハウスホールディングス	24,600	509.00	12,521,400
大東建託	46,000	15,695.00	721,970,000
新日本建設	15,400	1,093.00	16,832,200
N I P P O	34,200	1,861.00	63,646,200
東亜道路工業	2,400	3,570.00	8,568,000
前田道路	40,400	2,247.00	90,778,800
日本道路	3,500	6,060.00	21,210,000
東亜建設工業	11,300	1,711.00	19,334,300
若築建設	6,500	1,579.00	10,263,500
東洋建設	47,200	436.00	20,579,200
五洋建設	153,300	705.00	108,076,500
世紀東急工業	18,900	667.00	12,606,300
福田組	4,200	5,170.00	21,714,000
日本ドライケミカル	3,200	1,299.00	4,156,800
住友林業	91,400	1,647.00	150,535,800
日本基礎技術	13,500	373.00	5,035,500
巴コーポレーション	16,100	460.00	7,406,000
大和ハウス工業	357,200	3,584.00	1,280,204,800
ライト工業	24,800	1,450.00	35,960,000
積水ハウス	394,900	1,725.50	681,399,950
日特建設	11,000	729.00	8,019,000
北陸電気工事	6,300	1,055.00	6,646,500
ユアテック	20,700	911.00	18,857,700
四電工	1,800	2,644.00	4,759,200
中電工	16,600	2,477.00	41,118,200
関電工	58,700	1,162.00	68,209,400
きんでん	85,800	1,907.00	163,620,600
東京エネシス	13,300	962.00	12,794,600
トーエネック	3,500	3,240.00	11,340,000

住友電設	8,900	1,911.00	17,007,900
日本電設工業	22,000	2,347.00	51,634,000
協和エクシオ	50,500	2,960.00	149,480,000
新日本空調	10,900	1,877.00	20,459,300
日本工営	7,400	2,722.00	20,142,800
九電工	25,400	4,405.00	111,887,000
三機工業	29,600	1,270.00	37,592,000
日揮	111,100	1,884.00	209,312,400
中外炉工業	3,600	2,472.00	8,899,200
ヤマト	11,600	637.00	7,389,200
太平電業	8,700	2,794.00	24,307,800
高砂熱学工業	32,500	2,047.00	66,527,500
三晃金属工業	1,400	2,977.00	4,167,800
NEC ネットエスアイ	12,500	2,573.00	32,162,500
朝日工業社	2,500	3,195.00	7,987,500
明星工業	23,400	866.00	20,264,400
大気社	17,600	3,230.00	56,848,000
ダイダン	8,600	2,578.00	22,170,800
日比谷総合設備	12,300	1,921.00	23,628,300
東芝プラントシステム	27,900	2,326.00	64,895,400
日本製粉	38,400	1,887.00	72,460,800
日清製粉グループ本社	130,500	2,318.00	302,499,000
日東富士製粉	800	5,350.00	4,280,000
昭和産業	10,700	2,858.00	30,580,600
鳥越製粉	10,400	952.00	9,900,800
中部飼料	14,100	1,446.00	20,388,600
フィード・ワン	77,800	223.00	17,349,400
東洋精糖	1,900	1,212.00	2,302,800
日本甜菜製糖	6,600	1,993.00	13,153,800
三井製糖	9,100	3,045.00	27,709,500
塩水港精糖	13,500	247.00	3,334,500
日新製糖	5,500	2,274.00	12,507,000
L I F U L L	38,200	753.00	28,764,600
ジェイエシーリクルートメント	8,800	2,390.00	21,032,000
日本M&Aセンター	82,000	2,750.00	225,500,000
メンバーズ	3,700	1,121.00	4,147,700
中広	1,100	766.00	842,600
タケエイ	11,400	839.00	9,564,600
E・Jホールディングス	1,400	1,275.00	1,785,000
トラスト・テック	5,300	2,990.00	15,847,000
コシダカホールディングス	29,400	1,325.00	38,955,000
アルトナー	2,000	812.00	1,624,000
パソナグループ	10,400	1,348.00	14,019,200
C D S	2,700	1,315.00	3,550,500
リンクアンドモチベーション	20,200	1,071.00	21,634,200
G C A	11,200	845.00	9,464,000
エス・エム・エス	40,400	1,978.00	79,911,200
パーソルホールディングス	110,000	2,084.00	229,240,000
リニカル	6,200	1,691.00	10,484,200
クックパッド	34,500	419.00	14,455,500



エスクリ	3,000	734.00	2,202,000
アイ・ケイ・ケイ	5,500	722.00	3,971,000
森永製菓	29,100	4,965.00	144,481,500
中村屋	2,800	4,590.00	12,852,000
江崎グリコ	34,700	5,550.00	192,585,000
名糖産業	5,600	1,492.00	8,355,200
井村屋グループ	4,900	3,150.00	15,435,000
不二家	6,500	2,504.00	16,276,000
山崎製パン	94,500	2,280.00	215,460,000
第一屋製パン	1,900	1,103.00	2,095,700
モロゾフ	1,800	5,500.00	9,900,000
亀田製菓	7,200	5,380.00	38,736,000
寿スピリッツ	12,200	4,475.00	54,595,000
カルビー	52,700	3,765.00	198,415,500
森永乳業	23,100	3,340.00	77,154,000
六甲バター	8,400	2,478.00	20,815,200
ヤクルト本社	85,600	8,070.00	690,792,000
明治ホールディングス	81,900	8,710.00	713,349,000
雪印メグミルク	27,800	2,995.00	83,261,000
プリマハム	16,300	2,494.00	40,652,200
日本ハム	49,900	4,245.00	211,825,500
林兼産業	4,000	657.00	2,628,000
丸大食品	12,400	1,859.00	23,051,600
S Foods	10,400	4,800.00	49,920,000
伊藤ハム米久ホールディングス	74,400	749.00	55,725,600
学情	4,400	1,465.00	6,446,000
スタジオアリス	5,500	2,630.00	14,465,000
シミックホールディングス	6,100	2,173.00	13,255,300
システナ	40,300	1,338.00	53,921,400
NJS	2,400	1,768.00	4,243,200
デジタルアーツ	6,100	6,090.00	37,149,000
新日鉄住金ソリューションズ	16,900	3,280.00	55,432,000
総合警備保障	43,800	5,000.00	219,000,000
キューブシステム	6,000	814.00	4,884,000
いちご	144,400	403.00	58,193,200
エイジア	2,200	1,399.00	3,077,800
日本駐車場開発	136,800	161.00	22,024,800
コア	4,800	1,407.00	6,753,600
カカクコム	82,800	2,154.00	178,351,200
アイロムグループ	4,200	2,266.00	9,517,200
セントケア・ホールディング	6,000	591.00	3,546,000
サイネックス	1,600	812.00	1,299,200
ルネサンス	6,100	2,299.00	14,023,900
ディップ	17,700	2,384.00	42,196,800
SBSホールディングス	11,400	1,425.00	16,245,000
オプトホールディング	6,700	1,977.00	13,245,900
新日本科学	14,900	616.00	9,178,400
ツクイ	25,900	976.00	25,278,400
キャリアデザインセンター	2,800	1,622.00	4,541,600
エムスリー	231,600	1,804.00	417,806,400

ツカダ・グローバルホールディング	7,100	615.00	4,366,500
プラス	800	675.00	540,000
アウトソーシング	57,900	1,405.00	81,349,500
ウェルネット	11,100	1,119.00	12,420,900
ワールドホールディングス	3,000	2,784.00	8,352,000
ディー・エヌ・エー	59,300	2,143.00	127,079,900
博報堂DYホールディングス	152,900	1,781.00	272,314,900
ぐるなび	15,600	932.00	14,539,200
エスアールジータカミヤ	11,400	645.00	7,353,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,700	1,365.00	11,875,500
ファンコミュニケーションズ	30,200	614.00	18,542,800
ライク	4,300	1,672.00	7,189,600
ビジネス・ブレイクスルー	4,600	378.00	1,738,800
WDBホールディングス	5,000	2,903.00	14,515,000
ティア	5,100	771.00	3,932,100
CDG	1,000	1,481.00	1,481,000
バリューコマース	7,400	1,480.00	10,952,000
インフォマート	60,300	1,469.00	88,580,700
サッポロホールディングス	42,300	2,486.00	105,157,800
アサヒグループホールディングス	242,000	5,048.00	1,221,616,000
麒麟ホールディングス	522,700	2,609.50	1,363,985,650
宝ホールディングス	86,500	1,434.00	124,041,000
オエノンホールディングス	33,000	384.00	12,672,000
養命酒製造	3,600	2,327.00	8,377,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	88,500	3,340.00	295,590,000
サントリー食品インターナショナル	77,300	4,590.00	354,807,000
ダイドーグループホールディングス	6,500	5,990.00	38,935,000
伊藤園	38,300	5,230.00	200,309,000
キーコーヒー	11,400	2,097.00	23,905,800
ユニカフェ	3,600	1,292.00	4,651,200
ジャパンフーズ	1,600	1,236.00	1,977,600
日清オイリオグループ	14,900	3,500.00	52,150,000
不二製油グループ本社	28,200	3,290.00	92,778,000
かどや製油	1,200	6,080.00	7,296,000
J-オイルミルズ	6,000	3,900.00	23,400,000
ローソン	28,700	7,490.00	214,963,000
サンエー	8,600	4,795.00	41,237,000
カワチ薬品	8,800	2,250.00	19,800,000
エービーシー・マート	17,700	6,420.00	113,634,000
ハードオフコーポレーション	4,500	943.00	4,243,500
高千穂交易	4,400	1,068.00	4,699,200
アスクル	9,900	3,040.00	30,096,000
ゲオホールディングス	17,200	1,858.00	31,957,600
アダストリア	15,700	2,032.00	31,902,400
ジーフット	7,000	756.00	5,292,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,400	753.00	1,054,200
伊藤忠食品	2,700	5,210.00	14,067,000
くらコーポレーション	6,700	6,880.00	46,096,000
キャンドウ	5,400	1,721.00	9,293,400

エレマテック	5,300	2,298.00	12,179,400
パルグループホールディングス	5,800	3,280.00	19,024,000
JALUX	3,200	2,761.00	8,835,200
エディオン	48,000	1,222.00	58,656,000
あらた	6,300	4,710.00	29,673,000
サーラコーポレーション	23,000	685.00	15,755,000
ワッツ	3,800	828.00	3,146,400
トーメンデバイス	1,700	2,532.00	4,304,400
ハローズ	4,300	2,632.00	11,317,600
J Pホールディングス	31,400	341.00	10,707,400
あみやき亭	2,500	4,115.00	10,287,500
東京エレクトロン デバイス	4,100	2,055.00	8,425,500
ひらまつ	22,600	407.00	9,198,200
フィールズ	9,900	1,001.00	9,909,900
双日	626,100	421.00	263,588,100
アルフレッサ ホールディングス	126,000	3,120.00	393,120,000
大黒天物産	2,600	4,330.00	11,258,000
ハニーズホールディングス	11,000	920.00	10,120,000
ファーマライズホールディングス	2,500	641.00	1,602,500
キッコーマン	76,200	6,210.00	473,202,000
味の素	265,700	1,924.00	511,206,800
キュービー	64,300	2,770.00	178,111,000
ハウス食品グループ本社	44,100	3,900.00	171,990,000
カゴメ	46,300	3,300.00	152,790,000
焼津水産化学工業	5,700	1,050.00	5,985,000
アリアケジャパン	10,600	10,000.00	106,000,000
ピエトロ	1,500	1,649.00	2,473,500
エバラ食品工業	2,400	2,183.00	5,239,200
ニチレイ	60,000	3,055.00	183,300,000
横浜冷凍	29,700	931.00	27,650,700
東洋水産	59,400	3,945.00	234,333,000
イトアンド	4,000	1,690.00	6,760,000
大冷	1,400	1,865.00	2,611,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,100	677.00	2,098,700
日清食品ホールディングス	49,100	7,350.00	360,885,000
永谷園ホールディングス	6,200	2,716.00	16,839,200
一正蒲鉾	4,600	1,008.00	4,636,800
フジッコ	12,500	2,497.00	31,212,500
ロック・フィールド	12,500	1,702.00	21,275,000
日本たばこ産業	667,200	2,870.50	1,915,197,600
ケンコーマヨネーズ	6,500	2,219.00	14,423,500
わらべや日洋ホールディングス	7,600	1,908.00	14,500,800
なとり	6,500	1,864.00	12,116,000
イフジ産業	1,900	745.00	1,415,500
ピックルスコーポレーション	2,800	2,338.00	6,546,400
北の達人コーポレーション	45,400	531.00	24,107,400
ユーグレナ	45,900	674.00	30,936,600
片倉工業	13,900	1,220.00	16,958,000
ゲンゼ	8,300	4,615.00	38,304,500
ヒューリック	237,000	1,048.00	248,376,000

神栄	1,500	1,122.00	1,683,000
ラサ商事	6,100	957.00	5,837,700
アルペン	8,700	1,966.00	17,104,200
ハブ	3,600	943.00	3,394,800
ラクーンホールディングス	6,700	623.00	4,174,100
クオールホールディングス	16,700	2,116.00	35,337,200
アルコニックス	12,000	1,325.00	15,900,000
神戸物産	17,100	3,095.00	52,924,500
ソリトンシステムズ	6,400	987.00	6,316,800
ジーンズ	7,700	6,940.00	53,438,000
ビックカメラ	60,500	1,535.00	92,867,500
DCMホールディングス	61,100	1,128.00	68,920,800
ペッパーフードサービス	8,900	3,645.00	32,440,500
Monotaro	71,600	2,625.00	187,950,000
東京一番フーズ	2,300	633.00	1,455,900
DDホールディングス	2,500	2,573.00	6,432,500
あいホールディングス	18,200	2,173.00	39,548,600
ディービーエクス	3,900	1,236.00	4,820,400
きちり	2,900	838.00	2,430,200
アークランドサービスホールディングス	8,300	2,310.00	19,173,000
J.フロントリテイリング	145,000	1,615.00	234,175,000
ドトール・日レスホールディングス	19,900	2,128.00	42,347,200
マツモトキヨシホールディングス	46,900	4,225.00	198,152,500
ブロンコビリー	5,900	3,055.00	18,024,500
ZOZO	122,500	2,552.00	312,620,000
トレジャー・ファクトリー	3,400	714.00	2,427,600
物語コーポレーション	3,200	11,220.00	35,904,000
ココカラファイン	12,700	6,590.00	83,693,000
三越伊勢丹ホールディングス	212,000	1,363.00	288,956,000
東洋紡	47,700	1,611.00	76,844,700
ユニチカ	33,000	580.00	19,140,000
富士紡ホールディングス	5,900	3,475.00	20,502,500
日清紡ホールディングス	63,900	1,103.00	70,481,700
倉敷紡績	10,800	2,810.00	30,348,000
ダイワボウホールディングス	10,300	6,770.00	69,731,000
シキボウ	5,900	1,169.00	6,897,100
日東紡績	17,100	2,291.00	39,176,100
トヨタ紡織	40,200	1,938.00	77,907,600
マクニカ・富士エレホールディングス	31,400	1,713.00	53,788,200
Hamee	2,900	1,665.00	4,828,500
ラクト・ジャパン	2,500	7,380.00	18,450,000
ウエルシアホールディングス	30,000	6,290.00	188,700,000
クリエイトSDホールディングス	16,700	2,990.00	49,933,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,400	1,219.00	26,086,600
八洲電機	8,900	821.00	7,306,900
メディアスホールディングス	6,300	858.00	5,405,400
UKCホールディングス	7,300	2,540.00	18,542,000
ジューテックホールディングス	2,500	1,054.00	2,635,000

丸善CHIホールディングス	13,600	355.00	4,828,000
大光	2,800	712.00	1,993,600
OCHIホールディングス	3,200	1,252.00	4,006,400
TOKAIホールディングス	59,900	954.00	57,144,600
黒谷	1,800	504.00	907,200
ミサワ	2,200	472.00	1,038,400
ティーライフ	1,500	1,004.00	1,506,000
Cominix	1,700	854.00	1,451,800
エー・ピーカンパニー	2,100	622.00	1,306,200
三洋貿易	5,700	2,078.00	11,844,600
チムニー	3,500	2,776.00	9,716,000
シュッピン	7,700	1,120.00	8,624,000
ビューティガレージ	1,600	1,713.00	2,740,800
ウイン・パートナーズ	7,400	1,275.00	9,435,000
ネクステージ	17,400	1,128.00	19,627,200
ジョイフル本田	33,200	1,653.00	54,879,600
鳥貴族	3,700	2,202.00	8,147,400
キリン堂ホールディングス	4,500	1,558.00	7,011,000
ホットランド	5,900	1,472.00	8,684,800
すかいらーくホールディングス	105,600	1,778.00	187,756,800
綿半ホールディングス	4,200	2,797.00	11,747,400
日本毛織	37,000	930.00	34,410,000
ダイトウボウ	17,800	99.00	1,762,200
トーア紡コーポレーション	4,700	548.00	2,575,600
ガイドーリミテッド	14,100	368.00	5,188,800
ヨシックス	1,800	2,947.00	5,304,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,000	1,303.00	42,999,000
三栄建築設計	4,600	1,636.00	7,525,600
スター・マイカ	5,200	1,633.00	8,491,600
野村不動産ホールディングス	75,600	2,212.00	167,227,200
三重交通グループホールディングス	23,100	580.00	13,398,000
サムティ	15,700	1,550.00	24,335,000
ディア・ライフ	14,500	526.00	7,627,000
コーセーアールイー	3,400	874.00	2,971,600
エー・ディー・ワークス	160,900	38.00	6,114,200
日本商業開発	7,100	1,761.00	12,503,100
プレサンスコーポレーション	17,900	1,360.00	24,344,000
ユニゾホールディングス	17,100	2,328.00	39,808,800
THEグローバル社	5,200	653.00	3,395,600
日本管理センター	7,500	1,309.00	9,817,500
サンセイランディック	3,000	1,163.00	3,489,000
エストラスト	1,500	783.00	1,174,500
フージャースホールディングス	25,400	667.00	16,941,800
オープンハウス	18,500	4,620.00	85,470,000
東急不動産ホールディングス	305,200	630.00	192,276,000
飯田グループホールディングス	94,700	2,042.00	193,377,400
イーランド	1,600	740.00	1,184,000
ムゲンエステート	7,900	696.00	5,498,400
帝国繊維	12,600	2,673.00	33,679,800

日本コークス工業	97,800	107.00	10,464,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	910.00	4,186,000
ミタチ産業	2,700	792.00	2,138,400
B E E N O S	2,600	1,572.00	4,087,200
あさひ	9,400	1,408.00	13,235,200
日本調剤	4,000	3,460.00	13,840,000
コスモス薬品	5,700	23,180.00	132,126,000
シップヘルスケアホールディングス	23,600	3,830.00	90,388,000
トーエル	5,500	858.00	4,719,000
一六堂	2,400	512.00	1,228,800
ソフトクリエイイトホールディングス	4,900	1,693.00	8,295,700
オンリー	2,000	1,224.00	2,448,000
セブン&アイ・ホールディングス	475,300	5,030.00	2,390,759,000
薬王堂	4,900	3,540.00	17,346,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	30,500	1,259.00	38,399,500
明治電機工業	3,600	2,252.00	8,107,200
ツルハホールディングス	24,600	12,350.00	303,810,000
デリカフーズホールディングス	2,000	1,474.00	2,948,000
スターティアホールディングス	2,200	702.00	1,544,400
サンマルクホールディングス	8,900	2,750.00	24,475,000
フェリシモ	2,500	1,211.00	3,027,500
トリドールホールディングス	14,000	2,089.00	29,246,000
帝人	91,900	1,954.00	179,572,600
東レ	874,600	901.00	788,014,600
クラレ	190,300	1,642.00	312,472,600
旭化成	802,100	1,243.00	997,010,300
サカイオーベックス	2,800	2,421.00	6,778,800
T O K Y O B A S E	10,100	645.00	6,514,500
稲葉製作所	6,500	1,407.00	9,145,500
宮地エンジニアリンググループ	3,500	2,258.00	7,903,000
トーカロ	29,400	999.00	29,370,600
アルファ	4,000	1,423.00	5,692,000
S U M C O	125,800	1,638.00	206,060,400
川田テクノロジーズ	2,500	7,520.00	18,800,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,300	4,815.00	11,074,500
ピーロット	1,800	1,214.00	2,185,200
ファーストブラザーズ	3,100	1,299.00	4,026,900
ハウズドゥ	4,200	1,265.00	5,313,000
シーアールイー	3,700	992.00	3,670,400
プロパティエージェント	1,100	1,105.00	1,215,500
ケイアイスター不動産	3,000	1,879.00	5,637,000
アグレ都市デザイン	1,400	711.00	995,400
グッドコムアセット	2,000	1,512.00	3,024,000
ジェイ・エス・ピー	400	4,605.00	1,842,000
住江織物	3,000	2,736.00	8,208,000
日本フェルト	6,200	480.00	2,976,000
イチカワ	1,600	1,549.00	2,478,400
エコナックホールディングス	20,800	112.00	2,329,600
日東製網	1,300	1,560.00	2,028,000

芦森工業	2,400	1,796.00	4,310,400
アツギ	9,400	1,037.00	9,747,800
ウイルプラスホールディングス	1,100	938.00	1,031,800
ジャパンミート	4,300	2,152.00	9,253,600
コメダホールディングス	26,000	2,303.00	59,878,000
サツドラホールディングス	1,800	1,996.00	3,592,800
デファクトスタンダード	700	682.00	477,400
ダイユー・リックホールディングス	6,100	1,111.00	6,777,100
パロックジャパンリミテッド	9,100	1,034.00	9,409,400
クスリのアオキホールディングス	9,000	8,660.00	77,940,000
ダイニック	4,400	856.00	3,766,400
共和レザー	7,100	873.00	6,198,300
力の源ホールディングス	3,200	1,069.00	3,420,800
スシローグローバルホールディングス	12,400	6,400.00	79,360,000
L I X I L ビバ	9,600	1,845.00	17,712,000
セーレン	27,700	1,979.00	54,818,300
ソトー	4,300	998.00	4,291,400
東海染工	1,600	1,155.00	1,848,000
小松マテーレ	18,500	926.00	17,131,000
ワコールホールディングス	32,800	3,080.00	101,024,000
ホギメディカル	14,000	3,245.00	45,430,000
レナウン	32,800	118.00	3,870,400
クラウドシアホールディングス	2,700	512.00	1,382,400
T S I ホールディングス	41,600	813.00	33,820,800
マツオカコーポレーション	3,600	3,495.00	12,582,000
ワールド	11,600	2,311.00	26,807,600
T I S	37,600	5,280.00	198,528,000
ネオス	3,800	1,293.00	4,913,400
電算システム	4,300	2,262.00	9,726,600
グリー	60,600	488.00	29,572,800
コーエーテクモホールディングス	23,100	1,810.00	41,811,000
三菱総合研究所	4,400	3,890.00	17,116,000
ボルテージ	2,200	660.00	1,452,000
電算	1,200	2,104.00	2,524,800
A G S	6,400	788.00	5,043,200
ファインデックス	9,500	682.00	6,479,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	1,969.00	5,119,400
ブレインパッド	2,400	6,120.00	14,688,000
K L a b	20,100	1,065.00	21,406,500
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,500	2,387.00	17,902,500
イーブクイニシアティブジャパン	1,800	1,545.00	2,781,000
ネクソン	287,600	1,197.00	344,257,200
アイスタイル	28,700	1,007.00	28,900,900
エムアップ	3,900	2,368.00	9,235,200
エイチーム	7,100	1,861.00	13,213,100
テクノスジャパン	9,500	970.00	9,215,000
e n i s h	3,900	556.00	2,168,400
コロブラ	32,200	828.00	26,661,600
オルトプラス	6,900	409.00	2,822,100

ブロードリーフ	56,000	683.00	38,248,000
クロス・マーケティンググループ	3,100	467.00	1,447,700
デジタルハーツホールディングス	5,100	1,650.00	8,415,000
メディアドゥホールディングス	3,300	2,568.00	8,474,400
じげん	12,000	711.00	8,532,000
バイキューブ	5,900	538.00	3,174,200
サイバーリンクス	1,700	1,055.00	1,793,500
ディー・エル・イー	7,100	286.00	2,030,600
フィックスターズ	10,800	1,366.00	14,752,800
VOYAGE GROUP	6,000	1,380.00	8,280,000
オブティム	2,500	3,780.00	9,450,000
セレス	3,700	2,099.00	7,766,300
特種東海製紙	7,200	4,270.00	30,744,000
ベリサーブ	1,100	6,020.00	6,622,000
ティーガイア	11,300	2,486.00	28,091,800
セック	1,800	4,560.00	8,208,000
日本アジアグループ	12,000	381.00	4,572,000
豆蔵ホールディングス	7,700	1,081.00	8,323,700
テクマトリックス	8,000	1,877.00	15,016,000
プロシップ	1,600	2,600.00	4,160,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	272,200	232.00	63,150,400
GMOペイメントゲートウェイ	18,600	5,710.00	106,206,000
ザッパラス	5,600	381.00	2,133,600
システムリサーチ	1,500	3,545.00	5,317,500
インターネットイニシアティブ	18,400	2,516.00	46,294,400
さくらインターネット	13,500	568.00	7,668,000
ヴィンクス	3,800	1,726.00	6,558,800
GMOクラウド	2,500	3,045.00	7,612,500
SRAホールディングス	6,000	2,922.00	17,532,000
MINORIソリューションズ	2,200	1,504.00	3,308,800
システムインテグレータ	1,600	2,064.00	3,302,400
朝日ネット	9,500	518.00	4,921,000
eBASE	3,400	1,531.00	5,205,400
アバント	3,000	1,327.00	3,981,000
アドソル日進	4,000	2,006.00	8,024,000
フリービット	7,500	864.00	6,480,000
コムチュア	6,300	3,355.00	21,136,500
サイバーコム	2,000	1,817.00	3,634,000
アステリア	5,600	894.00	5,006,400
王子ホールディングス	507,600	764.00	387,806,400
日本製紙	54,000	2,095.00	113,130,000
三菱製紙	18,500	589.00	10,896,500
北越コーポレーション	74,800	576.00	43,084,800
中越パルプ工業	4,800	1,563.00	7,502,400
巴川製紙所	3,800	1,145.00	4,351,000
大王製紙	54,900	1,385.00	76,036,500
阿波製紙	2,800	584.00	1,635,200
マークラインズ	3,900	1,546.00	6,029,400
メディカル・データ・ビジョン	10,000	1,711.00	17,110,000



g u m i	13,000	654.00	8,502,000	
ショーケース・ティービー	2,400	995.00	2,388,000	
モバイルファクトリー	3,100	1,443.00	4,473,300	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,000	1,536.00	7,680,000	
P C Iホールディングス	2,000	2,964.00	5,928,000	
パイプドHD	1,800	1,032.00	1,857,600	
アイビーシー	1,800	1,270.00	2,286,000	
ネオジャパン	2,100	910.00	1,911,000	
P R T I M E S	700	1,987.00	1,390,900	
ランドコンピュータ	1,300	1,095.00	1,423,500	
オープンドア	5,600	2,589.00	14,498,400	
マイネット	3,600	1,111.00	3,999,600	
アカツキ	4,000	5,590.00	22,360,000	
ベネフィットジャパン	600	775.00	465,000	
U b i c o mホールディングス	2,000	1,080.00	2,160,000	
L I N E	34,400	3,390.00	116,616,000	
カナミックネットワーク	1,700	2,069.00	3,517,300	
ノムラシステムコーポレーション	900	1,081.00	972,900	
レンゴー	116,300	899.00	104,553,700	
トーモク	7,000	1,953.00	13,671,000	
ザ・パック	8,500	3,405.00	28,942,500	
チェンジ	700	4,770.00	3,339,000	
シンクロ・フード	4,800	621.00	2,980,800	
オークネット	5,900	1,194.00	7,044,600	
A O I T Y O H O L D I N G S	12,300	1,259.00	15,485,700	
マクロミル	14,200	1,952.00	27,718,400	
ビーグリー	2,100	1,387.00	2,912,700	
オロ	1,100	4,290.00	4,719,000	
昭和電工	74,900	4,865.00	364,388,500	
住友化学	887,500	610.00	541,375,000	
住友精化	5,500	4,840.00	26,620,000	
日産化学	69,200	5,900.00	408,280,000	
ラサ工業	4,000	1,854.00	7,416,000	
クレハ	10,400	7,880.00	81,952,000	
多木化学	1,600	8,130.00	13,008,000	
テイカ	9,200	2,090.00	19,228,000	
石原産業	21,700	1,506.00	32,680,200	
片倉コープアグリ	2,800	1,166.00	3,264,800	
日東エフシー	7,300	795.00	5,803,500	
日本曹達	17,800	2,776.00	49,412,800	
東ソー	174,300	1,561.00	272,082,300	
トクヤマ	32,500	2,687.00	87,327,500	
セントラル硝子	24,600	2,724.00	67,010,400	
東亜合成	70,800	1,231.00	87,154,800	
大阪ソーダ	12,100	2,749.00	33,262,900	
関東電化工業	26,700	1,089.00	29,076,300	
デンカ	44,300	3,590.00	159,037,000	
イビデン	70,500	1,620.00	114,210,000	
信越化学工業	198,700	10,170.00	2,020,779,000	

日本カーバイド工業	3,800	1,960.00	7,448,000
堺化学工業	7,500	2,846.00	21,345,000
第一稀元素化学工業	9,200	1,147.00	10,552,400
エア・ウォーター	92,400	1,872.00	172,972,800
大陽日酸	92,900	1,960.00	182,084,000
日本化学工業	3,800	2,701.00	10,263,800
東邦アセチレン	1,700	1,475.00	2,507,500
日本パーカライジング	61,600	1,488.00	91,660,800
高压ガス工業	18,000	879.00	15,822,000
チタン工業	1,400	2,503.00	3,504,200
四国化成工業	19,000	1,222.00	23,218,000
戸田工業	2,400	2,495.00	5,988,000
ステラ ケミファ	6,600	3,395.00	22,407,000
保土谷化学工業	3,900	2,753.00	10,736,700
日本触媒	19,000	7,080.00	134,520,000
大日精化工業	9,300	3,390.00	31,527,000
カネカ	30,000	4,440.00	133,200,000
協和発酵キリン	144,200	2,262.00	326,180,400
三菱瓦斯化学	116,000	1,844.00	213,904,000
三井化学	102,300	2,811.00	287,565,300
J S R	113,100	1,790.00	202,449,000
東京応化工業	19,300	3,160.00	60,988,000
大阪有機化学工業	10,400	1,431.00	14,882,400
三菱ケミカルホールディングス	753,700	940.40	708,779,480
K Hネオケム	17,100	3,315.00	56,686,500
ダイセル	175,100	1,279.00	223,952,900
住友ベークライト	19,500	4,170.00	81,315,000
積水化学工業	246,400	1,873.00	461,507,200
日本ゼオン	101,700	1,202.00	122,243,400
アイカ工業	33,800	3,425.00	115,765,000
宇部興産	56,900	2,563.00	145,834,700
積水樹脂	18,600	2,107.00	39,190,200
タキロンシーアイ	24,400	596.00	14,542,400
旭有機材	7,800	2,038.00	15,896,400
日立化成	52,100	1,803.00	93,936,300
ニチバン	5,900	2,244.00	13,239,600
リケンテクノス	30,800	518.00	15,954,400
大倉工業	5,800	2,111.00	12,243,800
積水化成品工業	16,800	1,002.00	16,833,600
群栄化学工業	2,700	3,215.00	8,680,500
タイガースポリマー	6,100	704.00	4,294,400
ミライアル	3,300	999.00	3,296,700
ダイキアクシス	4,000	1,350.00	5,400,000
ダイキョーニシカワ	23,800	1,026.00	24,418,800
竹本容器	2,000	2,847.00	5,694,000
森六ホールディングス	6,100	3,025.00	18,452,500
日本化薬	71,700	1,450.00	103,965,000
カーリットホールディングス	12,000	909.00	10,908,000
E P Sホールディングス	16,600	2,110.00	35,026,000
ソルクシーズ	4,800	855.00	4,104,000

レグス	2,700	1,137.00	3,069,900
プレステージ・インターナショナル	20,600	1,272.00	26,203,200
フェイス	3,900	1,243.00	4,847,700
ハイマックス	1,400	1,796.00	2,514,400
アミューズ	6,700	2,933.00	19,651,100
野村総合研究所	71,800	5,170.00	371,206,000
ドリームインキュベータ	3,300	1,905.00	6,286,500
サイバネットシステム	9,300	687.00	6,389,100
クイック	6,800	1,601.00	10,886,800
T A C	6,400	256.00	1,638,400
C Eホールディングス	3,000	791.00	2,373,000
ケネディクス	102,800	559.00	57,465,200
日本システム技術	1,800	2,014.00	3,625,200
電通	134,000	5,340.00	715,560,000
インテージホールディングス	14,500	1,085.00	15,732,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	2,233.00	9,378,600
東邦システムサイエンス	3,400	887.00	3,015,800
ぴあ	3,100	5,380.00	16,678,000
イオンファンタジー	3,500	3,700.00	12,950,000
ソースネクスト	21,800	1,035.00	22,563,000
シーティーエス	12,400	733.00	9,089,200
ネクシィーズグループ	3,400	1,994.00	6,779,600
メディカルシステムネットワーク	12,100	484.00	5,856,400
日本精化	9,100	1,119.00	10,182,900
扶桑化学工業	11,400	2,377.00	27,097,800
トリケミカル研究所	2,500	4,645.00	11,612,500
F I G	10,000	450.00	4,500,000
A D E K A	55,600	1,766.00	98,189,600
日油	43,400	3,705.00	160,797,000
ミヨシ油脂	4,700	1,271.00	5,973,700
新日本理化	20,500	214.00	4,387,000
ハリマ化成グループ	9,400	1,030.00	9,682,000
花王	279,500	7,752.00	2,166,684,000
第一工業製薬	4,200	2,605.00	10,941,000
石原ケミカル	2,900	2,110.00	6,119,000
日華化学	3,700	1,171.00	4,332,700
ニイタカ	1,700	1,788.00	3,039,600
三洋化成工業	7,600	5,450.00	41,420,000
武田薬品工業	454,500	4,559.00	2,072,065,500
アステラス製薬	1,061,400	1,712.00	1,817,116,800
大日本住友製薬	85,300	2,936.00	250,440,800
塩野義製薬	150,600	7,528.00	1,133,716,800
田辺三菱製薬	120,400	1,710.00	205,884,000
わかもと製薬	13,400	281.00	3,765,400
あすか製薬	14,200	1,200.00	17,040,000
日本新薬	30,100	7,480.00	225,148,000
ビオフェルミン製薬	1,800	2,878.00	5,180,400
中外製薬	120,000	6,890.00	826,800,000
科研製薬	20,800	5,810.00	120,848,000
エーザイ	137,800	10,350.00	1,426,230,000

理研ビタミン	5,500	3,660.00	20,130,000
ロート製薬	59,000	3,610.00	212,990,000
小野薬品工業	271,900	2,709.50	736,713,050
久光製薬	34,000	6,930.00	235,620,000
有機合成薬品工業	7,800	256.00	1,996,800
持田製薬	8,700	9,690.00	84,303,000
参天製薬	218,300	1,870.00	408,221,000
扶桑薬品工業	3,900	2,768.00	10,795,200
日本ケミファ	1,500	4,085.00	6,127,500
ツムラ	35,700	3,570.00	127,449,000
日医工	28,200	1,655.00	46,671,000
テルモ	162,900	6,335.00	1,031,971,500
みらかホールディングス	30,800	2,943.00	90,644,400
キッセイ薬品工業	20,400	3,475.00	70,890,000
生化学工業	22,300	1,616.00	36,036,800
栄研化学	20,200	2,471.00	49,914,200
日水製薬	4,900	1,255.00	6,149,500
鳥居薬品	6,200	2,391.00	14,824,200
JCRファーマ	8,100	5,340.00	43,254,000
東和薬品	5,500	8,880.00	48,840,000
富士製薬工業	7,800	1,884.00	14,695,200
沢井製薬	23,600	5,910.00	139,476,000
ゼリア新薬工業	22,800	2,104.00	47,971,200
第一三共	329,400	4,468.00	1,471,759,200
キョーリン製薬ホールディングス	29,500	2,700.00	79,650,000
大幸薬品	5,100	2,150.00	10,965,000
ダイト	6,700	3,505.00	23,483,500
大塚ホールディングス	219,300	5,683.00	1,246,281,900
大正製薬ホールディングス	25,800	12,440.00	320,952,000
ペプチドリーム	53,000	4,395.00	232,935,000
大日本塗料	12,800	1,142.00	14,617,600
日本ペイントホールディングス	93,000	3,745.00	348,285,000
関西ペイント	126,700	1,716.00	217,417,200
神東塗料	8,800	189.00	1,663,200
中国塗料	37,000	982.00	36,334,000
日本特殊塗料	8,400	1,872.00	15,724,800
藤倉化成	15,400	633.00	9,748,200
太陽ホールディングス	9,300	3,790.00	35,247,000
DIC	51,000	3,385.00	172,635,000
サカタインクス	24,600	1,177.00	28,954,200
東洋インキSCホールディングス	23,800	2,624.00	62,451,200
T&K TOKA	8,800	1,109.00	9,759,200
アルプス技研	9,600	2,155.00	20,688,000
サニックス	19,200	234.00	4,492,800
ダイオーズ	2,600	1,320.00	3,432,000
日本空調サービス	12,500	792.00	9,900,000
オリエンタルランド	130,000	10,955.00	1,424,150,000
フォーカスシステムズ	7,600	1,078.00	8,192,800
ダスキン	29,600	2,463.00	72,904,800
パーク24	66,300	3,015.00	199,894,500

明光ネットワークジャパン	13,900	998.00	13,872,200	
ファルコホールディングス	6,100	1,652.00	10,077,200	
クレスコ	3,400	3,520.00	11,968,000	
フジ・メディア・ホールディングス	117,200	1,809.00	212,014,800	
秀英予備校	2,300	494.00	1,136,200	
田谷	1,900	650.00	1,235,000	
ラウンドワン	34,100	1,152.00	39,283,200	
リゾートトラスト	46,500	1,722.00	80,073,000	
オービック	39,200	9,810.00	384,552,000	
ジャストシステム	16,100	2,298.00	36,997,800	
TDCソフト	9,900	976.00	9,662,400	
ヤフー	736,500	327.00	240,835,500	
ビー・エム・エル	14,200	2,869.00	40,739,800	
ワタベウェディング	1,700	791.00	1,344,700	
トレンドマイクロ	60,200	6,410.00	385,882,000	
りらいあコミュニケーションズ	19,900	1,054.00	20,974,600	
インフォメーション・ディベロプメント	3,200	1,624.00	5,196,800	
リソー教育	18,600	1,222.00	22,729,200	
日本オラクル	18,300	7,430.00	135,969,000	
早稲田アカデミー	1,500	2,412.00	3,618,000	
アルファシステムズ	3,700	2,805.00	10,378,500	
フューチャー	15,300	1,654.00	25,306,200	
CAC Holdings	8,500	1,081.00	9,188,500	
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	2,075.00	9,960,000	
トーセ	3,100	934.00	2,895,400	
ユー・エス・エス	134,400	2,068.00	277,939,200	
オービックビジネスコンサルタント	5,800	9,600.00	55,680,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	51,500	2,039.00	105,008,500	
アイティフォー	13,700	797.00	10,918,900	
東京個別指導学院	3,900	1,400.00	5,460,000	
東計電算	1,600	3,430.00	5,488,000	
サイバーエージェント	67,800	4,805.00	325,779,000	
楽天	512,700	934.00	478,861,800	
エクスネット	2,100	930.00	1,953,000	
クリーク・アンド・リバー社	6,400	1,031.00	6,598,400	
テー・オー・ダブリュー	10,500	881.00	9,250,500	
大塚商会	61,100	4,045.00	247,149,500	
サイボウズ	13,200	741.00	9,781,200	
ソフトブレイン	8,900	569.00	5,064,100	
セントラルスポーツ	4,100	3,775.00	15,477,500	
パラカ	2,900	1,932.00	5,602,800	
電通国際情報サービス	7,000	4,080.00	28,560,000	
デジタルガレージ	22,000	3,190.00	70,180,000	
イーエムシステムズ	9,100	1,255.00	11,420,500	
ウェザーニューズ	3,800	3,420.00	12,996,000	
C I J	8,900	753.00	6,701,700	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,162.00	2,378,200	
日本エンタープライズ	11,900	233.00	2,772,700	
WOWOW	5,400	3,315.00	17,901,000	

スカラ	9,100	918.00	8,353,800
フルキャストホールディングス	11,000	2,152.00	23,672,000
エン・ジャパン	12,000	4,100.00	49,200,000
富士フイルムホールディングス	239,100	4,702.00	1,124,248,200
コニカミノルタ	251,500	1,048.00	263,572,000
資生堂	228,700	7,039.00	1,609,819,300
ライオン	160,400	2,048.00	328,499,200
高砂香料工業	7,900	3,975.00	31,402,500
マンダム	25,900	3,190.00	82,621,000
ミルボン	14,200	4,215.00	59,853,000
ファンケル	25,600	5,430.00	139,008,000
コーセー	19,500	17,360.00	338,520,000
コタ	5,500	1,506.00	8,283,000
シーズ・ホールディングス	13,900	5,860.00	81,454,000
シーボン	1,300	2,712.00	3,525,600
ポーラ・オルビスホールディングス	49,100	3,045.00	149,509,500
ノエビアホールディングス	7,300	5,170.00	37,741,000
アジュバンコスメジャパン	2,600	996.00	2,589,600
エステー	8,200	2,140.00	17,548,000
アグロ カネショウ	4,700	2,309.00	10,852,300
コニシ	20,400	1,686.00	34,394,400
長谷川香料	13,700	2,045.00	28,016,500
星光P M C	7,700	932.00	7,176,400
小林製薬	32,300	7,360.00	237,728,000
荒川化学工業	10,400	1,601.00	16,650,400
メック	7,900	1,424.00	11,249,600
日本高純度化学	3,000	2,321.00	6,963,000
タカラバイオ	30,100	2,657.00	79,975,700
J C U	14,900	2,051.00	30,559,900
新田ゼラチン	7,300	778.00	5,679,400
O A Tアグリオ	1,600	2,510.00	4,016,000
デクセリアルズ	29,600	1,005.00	29,748,000
アース製薬	8,700	5,450.00	47,415,000
北興化学工業	12,000	594.00	7,128,000
大成ラミック	3,400	3,075.00	10,455,000
クミアイ化学工業	47,600	702.00	33,415,200
日本農薬	27,600	617.00	17,029,200
昭和シェル石油	107,700	2,025.00	218,092,500
富士興産	4,300	612.00	2,631,600
ニチレキ	14,800	1,089.00	16,117,200
ユシロ化学工業	6,000	1,400.00	8,400,000
ビーピー・カストロール	4,100	1,490.00	6,109,000
富士石油	27,900	380.00	10,602,000
M O R E S C O	4,200	1,675.00	7,035,000
出光興産	89,200	4,785.00	426,822,000
J X T Gホールディングス	1,959,700	724.90	1,420,586,530
コスモエネルギーホールディングス	33,300	3,945.00	131,368,500
横浜ゴム	66,700	2,320.00	154,744,000
東洋ゴム工業	59,100	1,701.00	100,529,100
ブリヂストン	353,800	4,263.00	1,508,249,400

住友ゴム工業	103,400	1,572.00	162,544,800
藤倉ゴム工業	10,200	533.00	5,436,600
オカモト	8,000	5,620.00	44,960,000
アキレス	8,400	2,299.00	19,311,600
フコク	5,200	966.00	5,023,200
ニッタ	13,000	4,095.00	53,235,000
クリエートメディック	3,900	1,111.00	4,332,900
住友理工	22,400	1,070.00	23,968,000
三ツ星ベルト	15,200	2,567.00	39,018,400
バンドー化学	22,000	1,330.00	29,260,000
A G C	116,100	3,880.00	450,468,000
日本板硝子	55,000	993.00	54,615,000
石塚硝子	1,500	2,221.00	3,331,500
有沢製作所	18,100	870.00	15,747,000
日本山村硝子	4,900	1,747.00	8,560,300
日本電気硝子	49,800	2,975.00	148,155,000
オハラ	4,500	2,420.00	10,890,000
住友大阪セメント	23,200	4,580.00	106,256,000
太平洋セメント	72,700	3,655.00	265,718,500
リソルホールディングス	1,200	4,150.00	4,980,000
日本ヒューム	11,600	931.00	10,799,600
日本コンクリート工業	25,000	323.00	8,075,000
三谷セキサン	5,400	2,808.00	15,163,200
アジアパイルホールディングス	16,300	702.00	11,442,600
東海カーボン	104,500	1,769.00	184,860,500
日本カーボン	5,500	6,290.00	34,595,000
東洋炭素	6,800	2,902.00	19,733,600
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	5,630.00	38,847,000
T O T O	88,600	4,365.00	386,739,000
日本碍子	140,500	1,683.00	236,461,500
日本特殊陶業	97,100	2,575.00	250,032,500
ダントーホールディングス	8,800	128.00	1,126,400
M A R U W A	4,000	6,440.00	25,760,000
品川リフラクトリーズ	3,000	5,050.00	15,150,000
黒崎播磨	2,300	7,260.00	16,698,000
ヨータイ	10,100	773.00	7,807,300
イソライト工業	5,900	509.00	3,003,100
東京窯業	14,700	424.00	6,232,800
ニッカトー	5,200	1,023.00	5,319,600
フジインコーポレーテッド	10,300	2,544.00	26,203,200
クニミネ工業	3,900	1,002.00	3,907,800
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,136.00	2,726,400
ニチアス	31,500	2,381.00	75,001,500
新日鐵住金	509,500	2,197.50	1,119,626,250
神戸製鋼所	208,300	984.00	204,967,200
中山製鋼所	15,800	610.00	9,638,000
合同製鐵	5,500	2,006.00	11,033,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	307,400	2,172.50	667,826,500
日新製鋼	27,500	1,552.00	42,680,000

東京製鐵	60,900	920.00	56,028,000
共英製鋼	12,800	2,354.00	30,131,200
大和工業	24,200	3,070.00	74,294,000
東京鐵鋼	4,700	1,474.00	6,927,800
大阪製鐵	7,600	2,014.00	15,306,400
淀川製鋼所	15,400	2,435.00	37,499,000
丸一鋼管	40,300	3,345.00	134,803,500
モリ工業	3,400	3,030.00	10,302,000
大同特殊鋼	18,600	4,620.00	85,932,000
日本高周波鋼業	4,300	700.00	3,010,000
日本冶金工業	94,100	293.00	27,571,300
山陽特殊製鋼	14,300	2,713.00	38,795,900
愛知製鋼	6,400	4,155.00	26,592,000
日立金属	122,700	1,404.00	172,270,800
日本金属	2,600	1,509.00	3,923,400
大平洋金属	7,700	3,245.00	24,986,500
新日本電工	68,100	267.00	18,182,700
栗本鐵工所	5,800	1,671.00	9,691,800
虹 技	1,600	1,672.00	2,675,200
日本鑄鉄管	1,200	1,318.00	1,581,600
日本製鋼所	34,500	2,466.00	85,077,000
三菱製鋼	8,500	1,952.00	16,592,000
日垂鋼業	16,200	324.00	5,248,800
日本精線	1,600	3,590.00	5,744,000
エンビプロ・ホールディングス	2,300	691.00	1,589,300
大紀アルミニウム工業所	18,700	704.00	13,164,800
日本軽金属ホールディングス	310,100	247.00	76,594,700
三井金属鉱業	30,700	2,587.00	79,420,900
東邦亜鉛	6,300	3,930.00	24,759,000
三菱マテリアル	75,200	3,025.00	227,480,000
住友金属鉱山	155,900	3,397.00	529,592,300
DOWAホールディングス	26,600	3,530.00	93,898,000
古河機械金属	18,800	1,495.00	28,106,000
エス・サイエンス	50,400	76.00	3,830,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,200	2,026.00	26,743,200
東邦チタニウム	20,400	1,408.00	28,723,200
UACJ	17,300	2,358.00	40,793,400
CKサンエツ	2,100	2,927.00	6,146,700
古河電気工業	32,800	3,150.00	103,320,000
住友電気工業	425,600	1,578.00	671,596,800
フジクラ	137,400	480.00	65,952,000
昭和電線ホールディングス	13,200	691.00	9,121,200
東京特殊電線	1,500	2,050.00	3,075,000
タツタ電線	22,600	562.00	12,701,200
カナレ電気	1,800	2,055.00	3,699,000
平河ヒューテック	4,700	1,363.00	6,406,100
リョービ	14,000	3,410.00	47,740,000
アールスティ	14,000	730.00	10,220,000
アサヒホールディングス	21,400	2,401.00	51,381,400
東洋製罐グループホールディングス	72,500	2,400.00	174,000,000



ホッカホールディングス	5,800	1,715.00	9,947,000
コロナ	6,400	1,138.00	7,283,200
横河ブリッジホールディングス	21,200	1,915.00	40,598,000
OSJBホールディングス	57,100	279.00	15,930,900
駒井ハルテック	2,200	2,303.00	5,066,600
高田機工	1,000	2,732.00	2,732,000
三和ホールディングス	117,600	1,349.00	158,642,400
文化シャッター	33,600	780.00	26,208,000
三協立山	15,800	1,324.00	20,919,200
アルインコ	9,100	1,067.00	9,709,700
東洋シャッター	2,800	640.00	1,792,000
LIXILグループ	168,000	1,451.00	243,768,000
日本フィルコン	8,800	605.00	5,324,000
ノーリツ	25,400	1,768.00	44,907,200
長府製作所	11,600	2,391.00	27,735,600
リンナイ	20,300	8,140.00	165,242,000
ユニプレス	22,300	2,264.00	50,487,200
ダイニチ工業	6,000	747.00	4,482,000
日東精工	15,700	638.00	10,016,600
三洋工業	1,400	2,066.00	2,892,400
岡部	23,100	988.00	22,822,800
ジーテクト	12,600	1,743.00	21,961,800
中国工業	1,700	609.00	1,035,300
東プレ	21,200	2,409.00	51,070,800
高周波熱錬	22,000	955.00	21,010,000
東京製綱	7,000	1,233.00	8,631,000
サンコール	6,500	785.00	5,102,500
モリテックスチール	8,900	475.00	4,227,500
パイオラックス	18,200	2,844.00	51,760,800
エイチワン	11,200	1,123.00	12,577,600
日本発条	113,400	991.00	112,379,400
中央発條	1,300	3,530.00	4,589,000
アドバネクス	1,500	1,902.00	2,853,000
三浦工業	49,300	2,779.00	137,004,700
タクマ	41,500	1,480.00	61,420,000
テクノプロ・ホールディングス	20,700	5,640.00	116,748,000
アトラ	2,100	498.00	1,045,800
インターワークス	2,100	794.00	1,667,400
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	1,277.00	4,469,500
Keeper 技研	3,600	1,108.00	3,988,800
ファーストロジック	2,100	843.00	1,770,300
三機サービス	1,700	1,929.00	3,279,300
Gunosy	6,800	2,816.00	19,148,800
デザインワン・ジャパン	2,100	483.00	1,014,300
イー・ガーディアン	5,200	2,615.00	13,598,000
リブセンス	5,900	353.00	2,082,700
ジャパンマテリアル	30,100	1,149.00	34,584,900
ベクトル	13,400	1,973.00	26,438,200
ウチヤマホールディングス	5,600	493.00	2,760,800

ライクキッズネクスト	2,300	1,092.00	2,511,600
キャリアリンク	4,000	432.00	1,728,000
I B J	7,400	733.00	5,424,200
アサンテ	4,400	2,231.00	9,816,400
N・フィールド	7,100	1,438.00	10,209,800
バリューHR	2,300	2,261.00	5,200,300
M&Aキャピタルパートナーズ	2,800	4,600.00	12,880,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,305.00	5,872,500
E R Iホールディングス	3,100	948.00	2,938,800
アビスト	1,700	3,760.00	6,392,000
シグマクシス	5,200	1,107.00	5,756,400
ウィルグループ	7,100	1,108.00	7,866,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,100	486.00	7,338,600
日本ビューホテル	3,500	1,274.00	4,459,000
リクルートホールディングス	788,000	3,028.00	2,386,064,000
エラン	3,800	3,325.00	12,635,000
ツガミ	25,500	1,047.00	26,698,500
オークマ	14,500	5,600.00	81,200,000
東芝機械	12,800	2,004.00	25,651,200
アマダホールディングス	175,600	1,115.00	195,794,000
アイダエンジニアリング	31,600	966.00	30,525,600
滝澤鉄工所	3,600	1,634.00	5,882,400
F U J I	34,100	1,504.00	51,286,400
牧野フライス製作所	13,300	4,475.00	59,517,500
オーエスジー	56,000	2,325.00	130,200,000
ダイジェット工業	1,300	1,883.00	2,447,900
旭ダイヤモンド工業	29,800	744.00	22,171,200
D M G森精機	72,000	1,563.00	112,536,000
ソディック	24,800	890.00	22,072,000
ディスコ	15,400	17,490.00	269,346,000
日東工器	6,200	2,570.00	15,934,000
日進工具	3,400	2,480.00	8,432,000
パンチ工業	7,900	617.00	4,874,300
富士ダイス	5,100	830.00	4,233,000
土木管理総合試験所	4,800	634.00	3,043,200
日本郵政	901,700	1,374.00	1,238,935,800
ベルシステム24ホールディングス	18,400	1,528.00	28,115,200
鎌倉新書	8,000	1,062.00	8,496,000
一蔵	1,400	733.00	1,026,200
L I T A L I C O	2,500	2,166.00	5,415,000
グローバルグループ	1,300	1,470.00	1,911,000
エボラブルアジア	3,100	2,255.00	6,990,500
アトラエ	2,100	2,392.00	5,023,200
ストライク	2,800	3,030.00	8,484,000
ソラスト	26,700	1,320.00	35,244,000
セラク	2,400	802.00	1,924,800
インソース	3,600	2,419.00	8,708,400
豊田自動織機	93,200	5,720.00	533,104,000
豊和工業	6,300	897.00	5,651,100

OKK	4,700	1,122.00	5,273,400
石川製作所	2,700	1,457.00	3,933,900
東洋機械金属	8,200	626.00	5,133,200
津田駒工業	2,400	2,076.00	4,982,400
エンシュウ	3,000	1,465.00	4,395,000
島精機製作所	15,700	3,355.00	52,673,500
オプトラ	11,100	2,140.00	23,754,000
NCホールディングス	3,500	608.00	2,128,000
フリー	9,100	936.00	8,517,600
ヤマシンフィルタ	19,800	880.00	17,424,000
日阪製作所	14,100	1,047.00	14,762,700
やまびこ	22,100	1,325.00	29,282,500
平田機工	5,400	7,310.00	39,474,000
ペガサスミシン製造	10,700	900.00	9,630,000
タツモ	3,600	1,124.00	4,046,400
ナプテスコ	62,600	2,836.00	177,533,600
三井海洋開発	12,100	3,100.00	37,510,000
レオン自動機	11,200	1,753.00	19,633,600
S M C	33,700	36,930.00	1,244,541,000
新川	8,600	507.00	4,360,200
ホソカワミクロン	4,000	5,320.00	21,280,000
ユニオンツール	4,900	3,980.00	19,502,000
オイレス工業	15,900	1,996.00	31,736,400
日精エー・エス・ピー機械	3,300	4,125.00	13,612,500
サトーホールディングス	13,700	3,015.00	41,305,500
技研製作所	7,900	3,945.00	31,165,500
日本エアーテック	3,500	725.00	2,537,500
カワタ	2,300	1,661.00	3,820,300
日精樹脂工業	9,600	1,097.00	10,531,200
オカダアイヨン	3,900	1,749.00	6,821,100
ワイエイシイホールディングス	4,600	782.00	3,597,200
小松製作所	521,200	3,115.00	1,623,538,000
住友重機械工業	65,900	3,690.00	243,171,000
日立建機	46,100	3,205.00	147,750,500
日工	3,200	2,503.00	8,009,600
巴工業	4,900	2,305.00	11,294,500
井関農機	11,500	2,025.00	23,287,500
T O W A	9,800	807.00	7,908,600
丸山製作所	2,400	1,650.00	3,960,000
北川鉄工所	5,200	2,909.00	15,126,800
シンニッタン	17,800	367.00	6,532,600
ローツェ	5,000	1,878.00	9,390,000
タカキタ	4,100	672.00	2,755,200
クボタ	617,500	1,885.50	1,164,296,250
荏原実業	3,300	1,879.00	6,200,700
東洋エンジニアリング	15,200	875.00	13,300,000
三菱化工機	4,000	1,716.00	6,864,000
月島機械	22,800	1,327.00	30,255,600
帝国電機製作所	8,000	1,786.00	14,288,000
東京機械製作所	4,400	427.00	1,878,800

新東工業	27,300	992.00	27,081,600
澁谷工業	10,100	4,210.00	42,521,000
アイチコーポレーション	19,900	660.00	13,134,000
小森コーポレーション	31,100	1,255.00	39,030,500
鶴見製作所	9,000	2,012.00	18,108,000
住友精密工業	1,800	3,595.00	6,471,000
酒井重工業	2,100	2,930.00	6,153,000
荏原製作所	51,000	3,345.00	170,595,000
石井鐵工所	1,700	1,884.00	3,202,800
西島製作所	11,800	939.00	11,080,200
北越工業	11,900	1,235.00	14,696,500
千代田化工建設	93,000	339.00	31,527,000
ダイキン工業	157,100	12,905.00	2,027,375,500
オルガノ	4,200	3,090.00	12,978,000
トーヨーカネツ	4,300	2,493.00	10,719,900
栗田工業	62,300	3,010.00	187,523,000
椿本チエイン	15,000	4,295.00	64,425,000
大同工業	5,500	1,019.00	5,604,500
日機装	37,200	1,284.00	47,764,800
木村化工機	9,600	402.00	3,859,200
新興プランテック	23,200	1,066.00	24,731,200
アネスト岩田	17,900	1,269.00	22,715,100
ダイフク	63,300	5,440.00	344,352,000
サムコ	3,200	1,194.00	3,820,800
加藤製作所	5,900	2,989.00	17,635,100
油研工業	2,000	2,170.00	4,340,000
タダノ	55,500	1,365.00	75,757,500
フジテック	41,800	1,351.00	56,471,800
C K D	32,000	1,261.00	40,352,000
キトー	8,700	1,919.00	16,695,300
平和	32,100	2,657.00	85,289,700
理想科学工業	10,200	2,062.00	21,032,400
S A N K Y O	28,800	4,445.00	128,016,000
日本金銭機械	12,700	1,071.00	13,601,700
マースグループホールディングス	7,300	2,362.00	17,242,600
福島工業	7,100	4,560.00	32,376,000
オーイズミ	4,700	495.00	2,326,500
ダイコク電機	5,300	1,645.00	8,718,500
竹内製作所	19,200	2,452.00	47,078,400
アマノ	32,900	2,333.00	76,755,700
J U K I	16,000	1,520.00	24,320,000
サンデンホールディングス	14,000	918.00	12,852,000
蛇の目マシン工業	10,500	580.00	6,090,000
ブラザー工業	150,000	1,882.00	282,300,000
マックス	17,700	1,523.00	26,957,100
モリタホールディングス	20,100	2,089.00	41,988,900
グローリー	31,900	3,015.00	96,178,500
新晃工業	10,700	1,628.00	17,419,600
大和冷機工業	16,600	1,275.00	21,165,000
セガサミーホールディングス	114,200	1,640.00	187,288,000

日本ピストンリング	4,200	2,145.00	9,009,000
リケン	5,300	5,560.00	29,468,000
T P R	15,500	2,718.00	42,129,000
ツバキ・ナカシマ	17,300	1,971.00	34,098,300
ホシザキ	33,600	9,110.00	306,096,000
大豊工業	9,400	1,144.00	10,753,600
日本精工	236,400	1,088.00	257,203,200
N T N	247,400	378.00	93,517,200
ジェイテクト	110,400	1,374.00	151,689,600
不二越	10,700	4,750.00	50,825,000
ミネベアミツミ	213,700	1,753.00	374,616,100
日本トムソン	34,200	596.00	20,383,200
T H K	71,800	2,586.00	185,674,800
ユーシン精機	8,900	1,282.00	11,409,800
前澤給装工業	4,500	1,888.00	8,496,000
イーグル工業	14,200	1,506.00	21,385,200
前澤工業	8,500	388.00	3,298,000
日本プラー工業	11,600	1,570.00	18,212,000
キッツ	46,600	963.00	44,875,800
日立製作所	518,300	3,467.00	1,796,946,100
三菱電機	1,151,100	1,464.50	1,685,785,950
富士電機	74,700	3,615.00	270,040,500
東洋電機製造	4,500	1,595.00	7,177,500
安川電機	133,400	3,345.00	446,223,000
シンフォニア テクノロジー	16,000	1,625.00	26,000,000
明電舎	22,800	1,619.00	36,913,200
オリジン電気	3,100	1,947.00	6,035,700
山洋電気	5,600	4,470.00	25,032,000
デンヨー	10,600	1,641.00	17,394,600
アイモバイル	2,600	705.00	1,833,000
キャリアインデックス	3,700	1,416.00	5,239,200
M S - J a p a n	4,400	1,497.00	6,586,800
船場	1,900	1,033.00	1,962,700
グレイステクノロジー	3,000	2,386.00	7,158,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,500	2,016.00	13,104,000
フルテック	1,200	1,136.00	1,363,200
グリーンズ	2,400	1,476.00	3,542,400
ツナグ・ソリューションズ	1,000	811.00	811,000
日総工産	2,700	2,280.00	6,156,000
キュービーネットホールディングス	5,600	2,013.00	11,272,800
三櫻工業	14,600	672.00	9,811,200
マキタ	140,100	4,585.00	642,358,500
東芝テック	14,400	3,200.00	46,080,000
芝浦メカトロニクス	2,000	4,270.00	8,540,000
マブチモーター	31,800	3,915.00	124,497,000
日本電産	138,500	14,530.00	2,012,405,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,200	2,532.00	15,698,400
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,588.00	6,193,200
東光高岳	5,800	1,691.00	9,807,800

ダブル・スコープ	16,800	1,180.00	19,824,000
宮越ホールディングス	4,300	901.00	3,874,300
ダイヘン	12,600	2,644.00	33,314,400
田淵電機	15,500	165.00	2,557,500
ヤーマン	16,700	1,995.00	33,316,500
JVCケンウッド	84,400	315.00	26,586,000
ミマキエンジニアリング	10,300	917.00	9,445,100
第一精工	4,800	1,333.00	6,398,400
日新電機	27,000	931.00	25,137,000
大崎電気工業	22,900	846.00	19,373,400
オムロン	122,300	4,845.00	592,543,500
日東工業	18,400	2,010.00	36,984,000
I D E C	15,400	2,467.00	37,991,800
不二電機工業	1,200	1,380.00	1,656,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	41,400	2,575.00	106,605,000
サクサホールディングス	2,800	2,166.00	6,064,800
メルコホールディングス	4,800	3,915.00	18,792,000
テクノメディカ	2,600	2,157.00	5,608,200
日本電気	149,000	3,305.00	492,445,000
富士通	111,000	7,086.00	786,546,000
沖電気工業	49,900	1,540.00	76,846,000
岩崎通信機	5,500	797.00	4,383,500
電気興業	6,000	2,573.00	15,438,000
サンケン電気	13,400	2,539.00	34,022,600
ナカヨ	2,100	1,532.00	3,217,200
アイホン	6,600	1,595.00	10,527,000
ルネサスエレクトロニクス	119,200	611.00	72,831,200
セイコーエプソン	142,800	1,866.00	266,464,800
ワコム	83,400	595.00	49,623,000
アルバック	26,400	4,165.00	109,956,000
アクセル	4,700	603.00	2,834,100
E I Z O	10,600	4,005.00	42,453,000
ジャパンディスプレイ	272,100	105.00	28,570,500
日本信号	29,300	1,022.00	29,944,600
京三製作所	24,700	520.00	12,844,000
能美防災	15,200	2,405.00	36,556,000
ホーチキ	7,300	1,262.00	9,212,600
星和電機	3,800	506.00	1,922,800
エレコム	10,400	2,917.00	30,336,800
パナソニック	1,315,100	1,160.00	1,525,516,000
シャープ	114,200	1,768.00	201,905,600
アンリツ	74,100	1,818.00	134,713,800
富士通ゼネラル	35,100	1,604.00	56,300,400
ソニー	771,700	6,056.00	4,673,415,200
T D K	60,200	9,570.00	576,114,000
帝国通信工業	5,100	1,239.00	6,318,900
タムラ製作所	44,300	617.00	27,333,100
アルプス電気	106,300	2,664.00	283,183,200
池上通信機	3,600	1,405.00	5,058,000
パイオニア	191,900	97.00	18,614,300

日本電波工業	10,500	523.00	5,491,500
鈴木	5,700	753.00	4,292,100
日本トリム	2,200	6,120.00	13,464,000
ローランド ディー・ジー	5,900	2,374.00	14,006,600
フォスター電機	13,500	1,605.00	21,667,500
クラリオン	10,100	2,471.00	24,957,100
SMK	3,200	2,463.00	7,881,600
ヨコオ	8,200	1,522.00	12,480,400
ティアック	8,000	262.00	2,096,000
ホシデン	33,900	933.00	31,628,700
ヒロセ電機	16,500	12,100.00	199,650,000
日本航空電子工業	26,400	1,481.00	39,098,400
TOA	12,400	1,126.00	13,962,400
マクセルホールディングス	24,800	1,643.00	40,746,400
古野電気	14,800	1,272.00	18,825,600
ユニデンホールディングス	3,400	2,637.00	8,965,800
アルパイン	19,900	1,912.00	38,048,800
スミダコーポレーション	9,800	1,452.00	14,229,600
アイコム	6,400	2,405.00	15,392,000
リオン	5,300	2,214.00	11,734,200
本多通信工業	9,900	625.00	6,187,500
船井電機	11,700	620.00	7,254,000
横河電機	115,200	2,284.00	263,116,800
新電元工業	4,100	4,655.00	19,085,500
アズビル	74,300	2,279.00	169,329,700
東亜ディーケーケー	5,700	1,041.00	5,933,700
日本光電工業	50,700	3,300.00	167,310,000
チノー	4,000	1,346.00	5,384,000
共和電業	12,200	430.00	5,246,000
日本電子材料	4,400	783.00	3,445,200
堀場製作所	22,800	5,370.00	122,436,000
アドバンテスト	78,400	2,324.00	182,201,600
小野測器	5,400	744.00	4,017,600
エスベック	10,200	2,071.00	21,124,200
キーエンス	56,500	60,840.00	3,437,460,000
日置電機	6,000	4,250.00	25,500,000
シスメックス	89,700	6,700.00	600,990,000
日本マイクロニクス	18,600	758.00	14,098,800
メガチップス	9,100	2,497.00	22,722,700
OBARA GROUP	6,700	4,785.00	32,059,500
IMAGICA GROUP	9,600	607.00	5,827,200
澤藤電機	1,400	2,034.00	2,847,600
デンソー	255,400	5,225.00	1,334,465,000
原田工業	3,500	873.00	3,055,500
コーセル	16,000	1,208.00	19,328,000
イリソ電子工業	10,500	4,995.00	52,447,500
オブテックスグループ	20,200	2,045.00	41,309,000
千代田インテグレ	4,800	2,396.00	11,500,800
アイ・オー・データ機器	4,800	1,293.00	6,206,400
レーザーテック	23,600	3,405.00	80,358,000

スタンレー電気	81,600	3,420.00	279,072,000
岩崎電気	4,500	1,571.00	7,069,500
ウシオ電機	69,900	1,324.00	92,547,600
岡谷電機産業	8,200	437.00	3,583,400
ヘリオス テクノ ホールディング	10,600	764.00	8,098,400
日本セラミック	11,700	2,829.00	33,099,300
遠藤照明	5,900	829.00	4,891,100
古河電池	8,200	818.00	6,707,600
双信電機	5,600	432.00	2,419,200
山一電機	8,300	1,304.00	10,823,200
図研	7,500	1,896.00	14,220,000
日本電子	22,700	1,952.00	44,310,400
カシオ計算機	101,800	1,659.00	168,886,200
ファナック	109,400	20,085.00	2,197,299,000
日本シイエムケイ	29,300	877.00	25,696,100
エンプラス	5,200	3,160.00	16,432,000
大真空	4,200	1,127.00	4,733,400
ローム	55,600	8,140.00	452,584,000
浜松ホトニクス	82,600	3,840.00	317,184,000
三井ハイテック	12,700	1,233.00	15,659,100
新光電気工業	38,600	790.00	30,494,000
京セラ	175,500	6,077.00	1,066,513,500
協栄産業	1,300	1,715.00	2,229,500
太陽誘電	51,200	2,325.00	119,040,000
村田製作所	120,800	17,850.00	2,156,280,000
ユーシン	18,200	978.00	17,799,600
双葉電子工業	18,800	1,777.00	33,407,600
日東電工	86,900	6,200.00	538,780,000
北陸電気工業	4,300	1,102.00	4,738,600
東海理化電機製作所	30,300	2,219.00	67,235,700
ニチコン	36,200	880.00	31,856,000
日本ケミコン	8,200	2,271.00	18,622,200
K O A	17,400	1,596.00	27,770,400
三井E & Sホールディングス	41,600	1,179.00	49,046,400
日立造船	91,200	412.00	37,574,400
三菱重工業	192,900	4,322.00	833,713,800
川崎重工業	89,600	2,707.00	242,547,200
I H I	88,500	4,005.00	354,442,500
名村造船所	34,600	550.00	19,030,000
サノヤスホールディングス	15,300	223.00	3,411,900
スプリックス	3,100	2,740.00	8,494,000
日本車輛製造	4,200	2,618.00	10,995,600
三菱ロジスネクスト	13,700	1,293.00	17,714,100
近畿車輛	1,700	2,390.00	4,063,000
F P G	36,300	1,289.00	46,790,700
島根銀行	2,500	1,001.00	2,502,500
じもとホールディングス	77,000	154.00	11,858,000
全国保証	32,000	4,270.00	136,640,000
めぶきフィナンシャルグループ	589,800	348.00	205,250,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,300	1,970.00	30,141,000



九州フィナンシャルグループ	186,200	537.00	99,989,400	
かんぽ生命保険	42,900	2,813.00	120,677,700	
ゆうちょ銀行	321,900	1,347.00	433,599,300	
富山第一銀行	27,400	452.00	12,384,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	723,100	512.00	370,227,200	
ジェイリース	2,400	621.00	1,490,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,700	1,212.00	88,112,400	
マーキュリアインベストメント	4,400	854.00	3,757,600	
イントラスト	3,200	444.00	1,420,800	
日本モーゲージサービス	1,500	1,258.00	1,887,000	
アルヒ	10,300	1,782.00	18,354,600	
日産自動車	1,357,800	1,029.00	1,397,176,200	
いすゞ自動車	363,900	1,614.50	587,516,550	
トヨタ自動車	1,282,900	6,709.00	8,606,976,100	*
日野自動車	143,700	1,091.00	156,776,700	
三菱自動車工業	426,100	762.00	324,688,200	
エフテック	8,100	1,098.00	8,893,800	
レシップホールディングス	4,200	726.00	3,049,200	
G M B	2,300	1,181.00	2,716,300	
ファルテック	1,900	988.00	1,877,200	
武蔵精密工業	27,100	1,720.00	46,612,000	
日産車体	22,500	988.00	22,230,000	
新明和工業	53,600	1,491.00	79,917,600	
極東開発工業	22,900	1,571.00	35,975,900	
日信工業	21,000	1,548.00	32,508,000	
トビー工業	9,500	2,725.00	25,887,500	
ティラド	4,200	2,801.00	11,764,200	
曙ブレーキ工業	63,200	194.00	12,260,800	
タチエス	19,500	1,507.00	29,386,500	
N O K	61,900	1,603.00	99,225,700	
フタバ産業	32,000	667.00	21,344,000	
K Y B	12,000	2,767.00	33,204,000	
市光工業	17,200	766.00	13,175,200	
大同メタル工業	18,700	889.00	16,624,300	
プレス工業	57,100	592.00	33,803,200	
ミクニ	14,600	603.00	8,803,800	
太平洋工業	24,100	1,642.00	39,572,200	
ケーヒン	26,400	2,087.00	55,096,800	
河西工業	14,100	997.00	14,057,700	
アイシン精機	94,800	4,395.00	416,646,000	
マツダ	361,300	1,204.50	435,185,850	
今仙電機製作所	10,700	1,059.00	11,331,300	
本田技研工業	971,200	3,282.00	3,187,478,400	
スズキ	210,600	5,425.00	1,142,505,000	
S U B A R U	357,400	2,674.50	955,866,300	
安永	5,600	1,864.00	10,438,400	
ヤマハ発動機	162,600	2,333.00	379,345,800	
ショーワ	27,200	1,557.00	42,350,400	

小糸製作所	69,000	6,000.00	414,000,000	
T B K	13,900	457.00	6,352,300	
エクセディ	15,600	2,961.00	46,191,600	
ミツバ	21,200	769.00	16,302,800	
豊田合成	37,200	2,316.00	86,155,200	
愛三工業	18,000	836.00	15,048,000	
盟和産業	1,700	1,173.00	1,994,100	
日本プラスト	9,000	916.00	8,244,000	
ヨロズ	10,800	1,625.00	17,550,000	
エフ・シー・シー	20,700	2,931.00	60,671,700	
新家工業	2,500	1,785.00	4,462,500	
シマノ	46,400	15,370.00	713,168,000	
テイ・エス テック	26,700	3,400.00	90,780,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	53,300	905.00	48,236,500	
三十三フィナンシャルグループ	9,800	1,999.00	19,590,200	
第四北越フィナンシャルグループ	19,700	4,025.00	79,292,500	
ジャムコ	5,800	2,964.00	17,191,200	
小野建	10,000	1,705.00	17,050,000	
はるやまホールディングス	5,200	906.00	4,711,200	
ノジマ	20,200	2,629.00	53,105,800	
佐島電機	8,400	1,071.00	8,996,400	
カッパ・クリエイト	15,900	1,456.00	23,150,400	
エコートレーディング	2,400	650.00	1,560,000	
伯東	7,800	1,352.00	10,545,600	
コンドーテック	8,800	1,053.00	9,266,400	
中山福	6,200	582.00	3,608,400	
ライトオン	9,600	956.00	9,177,600	
ナガイレーベン	16,400	2,658.00	43,591,200	
ジーンズメイト	3,400	658.00	2,237,200	
三菱食品	12,500	3,040.00	38,000,000	
良品計画	16,100	29,580.00	476,238,000	
三城ホールディングス	14,200	488.00	6,929,600	
松田産業	8,300	1,476.00	12,250,800	
第一興商	16,900	5,200.00	87,880,000	
メディバルホールディングス	122,400	2,522.00	308,692,800	
アドヴァン	17,400	1,096.00	19,070,400	
S P K	2,300	2,409.00	5,540,700	
萩原電気ホールディングス	4,200	3,325.00	13,965,000	
アルビス	4,300	3,055.00	13,136,500	
アズワン	8,100	8,410.00	68,121,000	
スズデン	4,000	1,346.00	5,384,000	
尾家産業	3,200	1,346.00	4,307,200	
シモジマ	7,000	1,125.00	7,875,000	
ドウシシャ	10,700	1,998.00	21,378,600	
小津産業	2,400	1,973.00	4,735,200	
コナカ	14,700	514.00	7,555,800	
高速	6,900	1,143.00	7,886,700	
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,901.00	2,661,400	
G - 7ホールディングス	3,300	2,578.00	8,507,400	
たけびし	4,000	1,557.00	6,228,000	

イオン北海道	11,500	814.00	9,361,000
コジマ	16,700	487.00	8,132,900
ヒマラヤ	3,600	978.00	3,520,800
コーナン商事	14,900	2,783.00	41,466,700
ネットワンシステムズ	40,000	2,287.00	91,480,000
エコス	4,200	2,136.00	8,971,200
ワタミ	14,900	1,437.00	21,411,300
マルシェ	3,100	801.00	2,483,100
リックス	2,500	1,667.00	4,167,500
システムソフト	27,300	115.00	3,139,500
ドンキホーテホールディングス	73,500	7,040.00	517,440,000
丸文	10,100	779.00	7,867,900
西松屋チェーン	24,900	1,029.00	25,622,100
ゼンショーホールディングス	53,500	2,642.00	141,347,000
ハビネット	9,500	1,708.00	16,226,000
幸楽苑ホールディングス	7,200	1,954.00	14,068,800
ハークスレイ	2,500	1,069.00	2,672,500
橋本総業ホールディングス	2,200	1,447.00	3,183,400
日本ライフライン	35,600	1,689.00	60,128,400
サイゼリヤ	18,700	2,245.00	41,981,500
タカショー	5,700	477.00	2,718,900
エクセル	4,200	1,989.00	8,353,800
V Tホールディングス	38,500	490.00	18,865,000
マルカキカイ	3,700	2,395.00	8,861,500
アルゴグラフィックス	4,800	4,445.00	21,336,000
魚力	3,200	1,429.00	4,572,800
I D O M	38,200	392.00	14,974,400
日本エム・ディ・エム	6,600	1,494.00	9,860,400
ポブラ	2,900	614.00	1,780,600
フジ・コーポレーション	2,300	2,041.00	4,694,300
ユナイテッドアローズ	13,000	4,160.00	54,080,000
進和	6,700	2,438.00	16,334,600
エスケイジャパン	2,700	891.00	2,405,700
ダイترون	5,200	1,672.00	8,694,400
ハイデイ日高	14,900	2,310.00	34,419,000
シークス	14,400	1,665.00	23,976,000
京都きもの友禅	7,300	467.00	3,409,100
コロワイド	37,700	2,867.00	108,085,900
ピーシーデポコーポレーション	15,000	556.00	8,340,000
田中商事	3,400	651.00	2,213,400
オーハシテクニカ	6,400	1,427.00	9,132,800
壱番屋	8,000	4,415.00	35,320,000
白銅	3,700	1,762.00	6,519,400
トップカルチャー	4,300	371.00	1,595,300
P L A N T	2,700	1,138.00	3,072,600
スギホールディングス	24,900	5,330.00	132,717,000
島津製作所	148,100	2,636.00	390,391,600
J M S	10,400	602.00	6,260,800
クボテック	2,400	346.00	830,400
長野計器	9,000	980.00	8,820,000

ブイ・テクノロジー	2,700	14,490.00	39,123,000
スター精密	19,800	1,625.00	32,175,000
東京計器	7,300	1,143.00	8,343,900
愛知時計電機	1,500	3,945.00	5,917,500
インターアクション	6,100	2,181.00	13,304,100
オーバル	10,900	278.00	3,030,200
東京精密	20,800	2,901.00	60,340,800
マニー	14,000	5,110.00	71,540,000
ニコン	200,600	1,876.00	376,325,600
トプコン	61,800	1,601.00	98,941,800
オリンパス	171,500	3,745.00	642,267,500
理研計器	10,200	2,300.00	23,460,000
S C R E E Nホールディングス	20,000	5,950.00	119,000,000
キヤノン電子	10,600	2,188.00	23,192,800
タムロン	10,200	1,858.00	18,951,600
H O Y A	231,800	6,917.00	1,603,360,600
シード	4,900	1,937.00	9,491,300
ノーリツ鋼機	9,100	1,881.00	17,117,100
エー・アンド・デイ	10,500	936.00	9,828,000
朝日インテック	41,600	4,840.00	201,344,000
キヤノン	619,800	3,298.00	2,044,100,400
リコー	346,100	1,133.00	392,131,300
シチズン時計	125,900	631.00	79,442,900
リズム時計工業	3,800	1,982.00	7,531,600
大研医器	9,200	787.00	7,240,400
メニコン	15,800	2,493.00	39,389,400
シンシア	1,700	544.00	924,800
中本パックス	3,200	1,844.00	5,900,800
スノーピーク	4,200	1,533.00	6,438,600
パラマウントベッドホールディングス	13,200	4,705.00	62,106,000
トランザクション	6,300	863.00	5,436,900
S H O B I	3,300	398.00	1,313,400
ニホンフラッシュ	4,900	2,006.00	9,829,400
前田工織	12,700	2,545.00	32,321,500
永大産業	15,400	432.00	6,652,800
アートネイチャー	12,300	680.00	8,364,000
バンダイナムコホールディングス	119,000	4,750.00	565,250,000
アイフィスジャパン	2,500	711.00	1,777,500
共立印刷	19,500	268.00	5,226,000
S H O E I	5,500	4,845.00	26,647,500
フランスベッドホールディングス	16,400	978.00	16,039,200
マーベラス	17,200	941.00	16,185,200
パイロットコーポレーション	20,100	5,690.00	114,369,000
萩原工業	6,400	1,717.00	10,988,800
エイベックス	19,400	1,512.00	29,332,800
トッパン・フォームズ	24,700	996.00	24,601,200
フジシールインターナショナル	25,800	3,465.00	89,397,000
タカラトミー	48,200	1,295.00	62,419,000
廣済堂	10,700	452.00	4,836,400
エステールホールディングス	3,300	724.00	2,389,200

アーク	43,900	98.00	4,302,200	
レック	12,300	1,967.00	24,194,100	
タカノ	4,600	872.00	4,011,200	
三光合成	8,900	410.00	3,649,000	
プロネクサス	9,900	1,100.00	10,890,000	
ホクシン	7,300	158.00	1,153,400	
ウッドワン	3,700	1,149.00	4,251,300	
大建工業	8,700	2,111.00	18,365,700	
きもと	19,600	230.00	4,508,000	
凸版印刷	162,500	1,723.00	279,987,500	
大日本印刷	162,200	2,591.00	420,260,200	
図書印刷	10,800	869.00	9,385,200	
共同印刷	3,600	2,620.00	9,432,000	
N I S S H A	23,600	2,086.00	49,229,600	
光村印刷	1,000	2,284.00	2,284,000	
藤森工業	10,300	3,245.00	33,423,500	
ヴィア・ホールディングス	13,900	709.00	9,855,100	
宝印刷	6,000	1,834.00	11,004,000	
前澤化成工業	8,000	1,106.00	8,848,000	
アシックス	114,300	1,544.00	176,479,200	
ツツミ	3,600	2,099.00	7,556,400	
ウェーブロックホールディングス	2,400	883.00	2,119,200	
J S P	6,700	2,388.00	15,999,600	
ニチハ	16,000	2,575.00	41,200,000	
エフピコ	9,500	6,490.00	61,655,000	
小松ウオール工業	3,500	2,157.00	7,549,500	
ヤマハ	68,500	5,260.00	360,310,000	
河合楽器製作所	3,500	3,955.00	13,842,500	
クリナップ	10,800	654.00	7,063,200	
ピジョン	69,600	5,160.00	359,136,000	
天馬	8,000	2,078.00	16,624,000	
兼松サステック	800	1,781.00	1,424,800	
キングジム	9,600	901.00	8,649,600	
象印マホービン	21,400	1,208.00	25,851,200	
リンテック	27,400	2,619.00	71,760,600	
信越ポリマー	20,700	891.00	18,443,700	
東リ	28,800	310.00	8,928,000	
イトーキ	21,200	606.00	12,847,200	
任天堂	70,900	36,290.00	2,572,961,000	
三菱鉛筆	19,000	2,098.00	39,862,000	
松風	5,800	1,267.00	7,348,600	
タカラスタンダード	23,800	1,805.00	42,959,000	
コクヨ	55,200	1,764.00	97,372,800	
ナカバヤシ	11,500	601.00	6,911,500	
ニフコ	46,100	2,777.00	128,019,700	
立川ブラインド工業	5,100	1,196.00	6,099,600	
グロープライド	5,600	2,967.00	16,615,200	
オカムラ	40,200	1,637.00	65,807,400	
バルカー	9,300	2,737.00	25,454,100	
M U T O Hホールディングス	1,500	2,291.00	3,436,500	

伊藤忠商事	832,100	2,080.00	1,730,768,000	
丸紅	1,118,100	891.80	997,121,580	
スクロール	17,400	461.00	8,021,400	
高島	1,800	2,036.00	3,664,800	
ヨンドシーホールディングス	12,600	2,469.00	31,109,400	
三陽商会	6,800	1,965.00	13,362,000	
長瀬産業	63,800	1,727.00	110,182,600	
ナイガイ	4,300	492.00	2,115,600	
蝶理	7,300	1,953.00	14,256,900	
豊田通商	126,600	4,050.00	512,730,000	
オンワードホールディングス	69,800	697.00	48,650,600	
三共生興	19,400	454.00	8,807,600	
兼松	45,300	1,512.00	68,493,600	
美津濃	11,400	2,605.00	29,697,000	
ツカモトコーポレーション	2,000	1,171.00	2,342,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	31,700	15,000.00	475,500,000	
ルックホールディングス	4,100	1,203.00	4,932,300	
三井物産	934,100	1,896.00	1,771,053,600	
日本紙パルプ商事	6,500	4,300.00	27,950,000	
東京エレクトロン	76,800	15,295.00	1,174,656,000	
日立ハイテクノロジーズ	34,500	4,100.00	141,450,000	
カメイ	14,800	1,379.00	20,409,200	
東都水産	1,600	2,271.00	3,633,600	
OUGホールディングス	1,900	2,695.00	5,120,500	
スターゼン	4,200	4,655.00	19,551,000	
セイコーホールディングス	17,800	2,676.00	47,632,800	
山善	44,300	1,171.00	51,875,300	
椿本興業	2,500	3,490.00	8,725,000	
住友商事	670,500	1,782.00	1,194,831,000	
日本ユニシス	35,300	2,764.00	97,569,200	
内田洋行	5,200	2,741.00	14,253,200	
三菱商事	795,600	3,117.00	2,479,885,200	
第一実業	5,200	3,905.00	20,306,000	
キャノンマーケティングジャパン	32,400	2,170.00	70,308,000	
西華産業	6,400	1,806.00	11,558,400	
佐藤商事	10,200	1,036.00	10,567,200	
菱洋エレクトロ	11,500	1,713.00	19,699,500	
東京産業	11,300	618.00	6,983,400	
ユアサ商事	11,600	3,650.00	42,340,000	
神鋼商事	2,500	2,891.00	7,227,500	
小林産業	6,600	310.00	2,046,000	
阪和興業	19,700	3,445.00	67,866,500	
正栄食品工業	6,000	4,555.00	27,330,000	
カナデン	10,900	1,282.00	13,973,800	
菱電商事	9,000	1,605.00	14,445,000	
ニプロ	79,700	1,496.00	119,231,200	
フルサト工業	6,300	1,909.00	12,026,700	
岩谷産業	25,100	4,020.00	100,902,000	
すてきナイスグループ	4,700	1,157.00	5,437,900	

昭光通商	4,100	822.00	3,370,200	
ニチモウ	1,700	1,748.00	2,971,600	
極東貿易	3,500	2,009.00	7,031,500	
イワキ	13,600	551.00	7,493,600	
兼松エレクトロニクス	6,100	3,785.00	23,088,500	
三愛石油	30,400	1,215.00	36,936,000	
稲畑産業	27,200	1,624.00	44,172,800	
G S Iクレオス	3,000	1,511.00	4,533,000	
明和産業	10,700	447.00	4,782,900	
キムラタン	53,600	32.00	1,715,200	
ゴールドウイン	10,200	10,740.00	109,548,000	
ユニ・チャーム	244,100	3,149.00	768,670,900	
デサント	27,500	2,717.00	74,717,500	
キング	5,800	494.00	2,865,200	
ワキタ	24,200	1,262.00	30,540,400	
ヤマトインターナショナル	7,500	464.00	3,480,000	
東邦ホールディングス	33,600	3,125.00	105,000,000	
サンゲツ	34,300	2,180.00	74,774,000	
ミツウロコグループホールディングス	16,500	717.00	11,830,500	
シナネンホールディングス	4,700	2,704.00	12,708,800	
伊藤忠エネクス	25,000	1,099.00	27,475,000	
サンリオ	35,000	2,190.00	76,650,000	
サンワテクノス	6,900	1,314.00	9,066,600	
リョーサン	12,500	3,515.00	43,937,500	
新光商事	10,700	1,768.00	18,917,600	
トーホー	5,200	2,355.00	12,246,000	
三信電気	9,400	2,036.00	19,138,400	
東陽テクニカ	13,100	931.00	12,196,100	
モスフードサービス	14,900	3,015.00	44,923,500	
加賀電子	11,300	2,328.00	26,306,400	
三益半導体工業	8,900	1,530.00	13,617,000	
ソーダニッカ	11,900	655.00	7,794,500	
立花エレテック	8,400	1,783.00	14,977,200	
木曽路	13,900	2,622.00	36,445,800	
S R Sホールディングス	13,400	1,011.00	13,547,400	
千趣会	20,500	302.00	6,191,000	
タカキュー	8,600	196.00	1,685,600	
ケーヨー	21,000	584.00	12,264,000	
上新電機	13,400	2,950.00	39,530,000	
日本瓦斯	20,800	3,650.00	75,920,000	
ロイヤルホールディングス	20,100	2,729.00	54,852,900	
東天紅	800	1,516.00	1,212,800	
いなげや	12,700	1,622.00	20,599,400	
島忠	25,700	3,015.00	77,485,500	
チヨダ	11,900	2,096.00	24,942,400	
ライフコーポレーション	8,600	2,820.00	24,252,000	
リンガーハット	14,000	2,393.00	33,502,000	
M r M a x H D	15,600	535.00	8,346,000	
テンアライド	10,800	424.00	4,579,200	
A O K Iホールディングス	22,700	1,475.00	33,482,500	

オークワ	16,200	1,198.00	19,407,600
コメリ	17,500	2,939.00	51,432,500
青山商事	21,800	2,991.00	65,203,800
しまむら	13,200	9,750.00	128,700,000
はせがわ	5,700	473.00	2,696,100
高島屋	88,900	1,893.00	168,287,700
松屋	22,800	1,116.00	25,444,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	58,200	1,914.00	111,394,800
近鉄百貨店	4,400	3,655.00	16,082,000
パルコ	10,900	1,267.00	13,810,300
丸井グループ	95,900	2,692.00	258,162,800
クレディセゾン	79,500	1,854.00	147,393,000
アクシアル リテイリング	9,400	3,915.00	36,801,000
井筒屋	6,000	256.00	1,536,000
イオン	436,300	2,774.00	1,210,296,200
イズミ	23,000	6,470.00	148,810,000
フォーバル	5,000	991.00	4,955,000
平和堂	23,000	3,040.00	69,920,000
フジ	13,700	2,183.00	29,907,100
ヤオコー	12,900	6,370.00	82,173,000
ゼビオホールディングス	13,700	1,593.00	21,824,100
ケーズホールディングス	117,800	1,262.00	148,663,600
PALTAC	20,400	5,760.00	117,504,000
三谷産業	13,500	320.00	4,320,000
Olympicグループ	6,700	776.00	5,199,200
日産東京販売ホールディングス	17,000	351.00	5,967,000
新生銀行	83,300	1,762.00	146,774,600
あおぞら銀行	63,400	3,955.00	250,747,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,907,500	680.00	5,377,100,000
りそなホールディングス	1,245,900	611.00	761,244,900
三井住友トラスト・ホールディングス	223,200	4,610.00	1,028,952,000
三井住友フィナンシャルグループ	800,300	4,502.00	3,602,950,600
千葉銀行	402,100	739.00	297,151,900
群馬銀行	227,000	551.00	125,077,000
武蔵野銀行	16,900	3,135.00	52,981,500
千葉興業銀行	31,200	451.00	14,071,200
筑波銀行	47,300	254.00	12,014,200
七十七銀行	35,600	2,372.00	84,443,200
青森銀行	8,800	3,045.00	26,796,000
秋田銀行	7,300	2,596.00	18,950,800
山形銀行	12,800	2,400.00	30,720,000
岩手銀行	7,900	4,410.00	34,839,000
東邦銀行	101,500	393.00	39,889,500
東北銀行	5,900	1,314.00	7,752,600
みちのく銀行	7,300	1,824.00	13,315,200
ふくおかフィナンシャルグループ	92,200	2,843.00	262,124,600
静岡銀行	285,700	1,078.00	307,984,600
十六銀行	15,200	2,660.00	40,432,000
スルガ銀行	116,100	527.00	61,184,700
八十二銀行	205,400	508.00	104,343,200



山梨中央銀行	14,100	1,739.00	24,519,900
大垣共立銀行	17,900	2,620.00	46,898,000
福井銀行	9,700	2,005.00	19,448,500
北國銀行	12,100	4,265.00	51,606,500
清水銀行	4,700	1,936.00	9,099,200
富山銀行	2,100	3,940.00	8,274,000
滋賀銀行	22,700	2,801.00	63,582,700
南都銀行	13,300	2,659.00	35,364,700
百五銀行	102,100	443.00	45,230,300
京都銀行	40,700	5,350.00	217,745,000
紀陽銀行	40,200	1,732.00	69,626,400
ほくほくフィナンシャルグループ	75,600	1,490.00	112,644,000
広島銀行	167,500	711.00	119,092,500
山陰合同銀行	67,300	926.00	62,319,800
中国銀行	73,200	1,063.00	77,811,600
鳥取銀行	4,000	1,611.00	6,444,000
伊予銀行	150,300	686.00	103,105,800
百十四銀行	12,100	3,010.00	36,421,000
四国銀行	16,300	1,375.00	22,412,500
阿波銀行	18,200	3,115.00	56,693,000
大分銀行	7,000	3,750.00	26,250,000
宮崎銀行	7,600	3,295.00	25,042,000
佐賀銀行	6,900	2,179.00	15,035,100
十八銀行	7,000	3,130.00	21,910,000
沖縄銀行	10,400	3,945.00	41,028,000
琉球銀行	26,200	1,326.00	34,741,200
セブン銀行	383,500	377.00	144,579,500
みずほフィナンシャルグループ	15,428,600	196.60	3,033,262,760
高知銀行	4,200	973.00	4,086,600
山口フィナンシャルグループ	141,700	1,192.00	168,906,400
芙蓉総合リース	13,000	6,400.00	83,200,000
興銀リース	21,300	2,873.00	61,194,900
東京センチュリー	22,900	5,650.00	129,385,000
SBIホールディングス	135,300	3,165.00	428,224,500
日本証券金融	50,000	656.00	32,800,000
アイフル	173,000	310.00	53,630,000
日本アジア投資	9,900	277.00	2,742,300
長野銀行	3,800	1,696.00	6,444,800
名古屋銀行	9,200	3,750.00	34,500,000
北洋銀行	171,000	342.00	58,482,000
愛知銀行	4,100	4,575.00	18,757,500
中京銀行	4,700	2,283.00	10,730,100
大光銀行	3,700	2,088.00	7,725,600
愛媛銀行	15,900	1,221.00	19,413,900
トマト銀行	4,500	1,345.00	6,052,500
京葉銀行	50,100	818.00	40,981,800
栃木銀行	58,800	316.00	18,580,800
北日本銀行	3,600	2,487.00	8,953,200
東和銀行	19,900	950.00	18,905,000
福島銀行	9,900	607.00	6,009,300

大東銀行	5,500	916.00	5,038,000
リコーリース	8,900	3,685.00	32,796,500
イオンフィナンシャルサービス	72,500	2,285.00	165,662,500
アコム	228,200	433.00	98,810,600
ジャックス	12,500	2,282.00	28,525,000
オリエントコーポレーション	306,900	188.00	57,697,200
日立キャピタル	26,800	3,020.00	80,936,000
アプラスフィナンシャル	55,100	99.00	5,454,900
オリックス	757,600	1,809.50	1,370,877,200
三菱UFJリース	256,200	594.00	152,182,800
ジャフコ	18,600	4,555.00	84,723,000
九州リースサービス	5,600	701.00	3,925,600
トモニホールディングス	87,700	456.00	39,991,200
大和証券グループ本社	911,000	643.10	585,864,100
野村ホールディングス	2,083,600	528.00	1,100,140,800
岡三証券グループ	96,700	573.00	55,409,100
丸三証券	33,700	911.00	30,700,700
東洋証券	40,700	227.00	9,238,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	135,400	626.00	84,760,400
光世証券	2,700	1,092.00	2,948,400
水戸証券	32,900	342.00	11,251,800
いちよし証券	23,800	972.00	23,133,600
松井証券	55,600	1,222.00	67,943,200
SOMPOホールディングス	222,700	4,893.00	1,089,671,100
だいこう証券ビジネス	4,700	519.00	2,439,300
日本取引所グループ	306,600	2,158.00	661,642,800
マネックスグループ	106,000	507.00	53,742,000
カブドットコム証券	84,800	426.00	36,124,800
極東証券	15,200	1,367.00	20,778,400
岩井コスモホールディングス	11,600	1,500.00	17,400,000
藍澤証券	21,300	768.00	16,358,400
フィデアホールディングス	110,500	151.00	16,685,500
池田泉州ホールディングス	120,500	359.00	43,259,500
アニコムホールディングス	8,800	3,770.00	33,176,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	296,900	3,548.00	1,053,401,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	93,300	2,654.00	247,618,200
マネーパートナーズグループ	13,300	384.00	5,107,200
小林洋行	3,200	288.00	921,600
第一生命ホールディングス	642,400	2,217.50	1,424,522,000
東京海上ホールディングス	411,600	5,542.00	2,281,087,200
アドバンテッジリスクマネジメント	4,300	1,086.00	4,669,800
イー・ギャランティ	10,600	990.00	10,494,000
アサックス	4,600	591.00	2,718,600
NECキャピタルソリューション	4,700	1,763.00	8,286,100
T&Dホールディングス	351,100	1,870.50	656,732,550
アドバンスクリエイト	2,600	2,020.00	5,252,000
三井不動産	602,400	2,751.50	1,657,503,600

三菱地所	795,500	1,859.00	1,478,834,500
平和不動産	21,500	2,011.00	43,236,500
東京建物	124,000	1,207.00	149,668,000
ダイビル	33,400	1,184.00	39,545,600
京阪神ビルディング	20,300	905.00	18,371,500
住友不動産	255,200	4,154.00	1,060,100,800
太平洋興発	4,600	873.00	4,015,800
大京	18,100	2,965.00	53,666,500
テーオーシー	26,000	910.00	23,660,000
東京楽天地	1,700	5,040.00	8,568,000
レオパレス21	144,500	490.00	70,805,000
スターツコーポレーション	15,400	2,658.00	40,933,200
フジ住宅	14,500	893.00	12,948,500
空港施設	13,500	593.00	8,005,500
明和地所	6,300	635.00	4,000,500
ゴールドクレスト	8,900	1,891.00	16,829,900
リログループ	60,100	2,897.00	174,109,700
日本エスリード	4,400	1,523.00	6,701,200
日神不動産	16,800	530.00	8,904,000
日本エスコン	20,500	720.00	14,760,000
タカラレーベン	53,100	329.00	17,469,900
サンヨーハウジング名古屋	6,400	1,036.00	6,630,400
イオンモール	56,900	2,143.00	121,936,700
ファースト住建	4,300	1,210.00	5,203,000
ランド	462,200	10.00	4,622,000
カチタス	12,600	3,120.00	39,312,000
東祥	6,800	3,740.00	25,432,000
トーセイ	15,600	1,036.00	16,161,600
穴吹興産	1,200	3,055.00	3,666,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	70,600	1,679.00	118,537,400
サンフロンティア不動産	15,700	1,178.00	18,494,600
エフ・ジェー・ネクスト	9,900	924.00	9,147,600
インテリックス	3,300	797.00	2,630,100
ランドビジネス	5,800	556.00	3,224,800
グランディハウス	10,000	445.00	4,450,000
東武鉄道	121,400	3,250.00	394,550,000
相鉄ホールディングス	39,500	3,465.00	136,867,500
東京急行電鉄	312,700	1,931.00	603,823,700
京浜急行電鉄	157,700	1,766.00	278,498,200
小田急電鉄	184,400	2,433.00	448,645,200
京王電鉄	64,300	6,130.00	394,159,000
京成電鉄	86,300	3,575.00	308,522,500
富士急行	15,700	3,000.00	47,100,000
新京成電鉄	2,900	2,156.00	6,252,400
東日本旅客鉄道	204,700	10,155.00	2,078,728,500
西日本旅客鉄道	103,200	7,886.00	813,835,200
東海旅客鉄道	103,100	22,105.00	2,279,025,500
西武ホールディングス	146,700	2,197.00	322,299,900
鴻池運輸	18,400	1,793.00	32,991,200
西日本鉄道	31,900	2,907.00	92,733,300

ハマキョウレックス	8,800	3,950.00	34,760,000
サカイ引越センター	6,100	6,280.00	38,308,000
近鉄グループホールディングス	109,000	4,500.00	490,500,000
阪急阪神ホールディングス	145,400	3,820.00	555,428,000
南海電気鉄道	48,600	2,767.00	134,476,200
京阪ホールディングス	48,500	4,650.00	225,525,000
神戸電鉄	2,800	3,995.00	11,186,000
名古屋鉄道	87,300	2,825.00	246,622,500
山陽電気鉄道	8,400	2,341.00	19,664,400
トランコム	3,100	6,550.00	20,305,000
日本通運	42,800	7,440.00	318,432,000
ヤマトホールディングス	191,100	2,948.50	563,458,350
山九	30,300	5,670.00	171,801,000
日新	9,400	2,048.00	19,251,200
丸運	5,800	330.00	1,914,000
丸全昭和運輸	8,800	3,045.00	26,796,000
センコーグループホールディングス	60,100	824.00	49,522,400
トナミホールディングス	2,600	6,100.00	15,860,000
ニッコンホールディングス	41,500	2,937.00	121,885,500
日本石油輸送	1,300	2,815.00	3,659,500
福山通運	14,000	4,850.00	67,900,000
セイノーホールディングス	81,700	1,760.00	143,792,000
エスライン	2,900	1,217.00	3,529,300
神奈川中央交通	2,700	3,825.00	10,327,500
日立物流	24,000	3,010.00	72,240,000
丸和運輸機関	5,700	3,595.00	20,491,500
C & F ロジホールディングス	11,100	1,420.00	15,762,000
日本郵船	91,200	1,923.00	175,377,600
商船三井	64,700	2,718.00	175,854,600
川崎汽船	33,600	1,660.00	55,776,000
N S ユナイテッド海運	6,000	2,787.00	16,722,000
明治海運	11,300	389.00	4,395,700
飯野海運	51,600	490.00	25,284,000
共栄タンカー	800	1,919.00	1,535,200
九州旅客鉄道	91,500	3,540.00	323,910,000
S G ホールディングス	103,000	2,834.00	291,902,000
日本航空	199,600	4,111.00	820,555,600
A N A ホールディングス	199,300	4,030.00	803,179,000
パスコ	2,100	1,229.00	2,580,900
西本W i s m e t t a c ホールディングス	2,600	5,140.00	13,364,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,265.00	1,138,500
Genky Drug Stores	4,400	3,545.00	15,598,000
国際紙パルプ商事	19,900	344.00	6,845,600
総合メディカルホールディングス	9,900	2,640.00	26,136,000
ブックオフグループホールディングス	6,000	756.00	4,536,000
三菱倉庫	37,700	2,742.00	103,373,400
三井倉庫ホールディングス	13,400	2,058.00	27,577,200
住友倉庫	41,000	1,436.00	58,876,000
澁澤倉庫	6,100	1,638.00	9,991,800

ヤマタネ	5,700	1,863.00	10,619,100
東陽倉庫	19,200	308.00	5,913,600
乾汽船	9,800	952.00	9,329,600
日本トランスシティ	24,100	490.00	11,809,000
ケイヒン	2,000	1,436.00	2,872,000
中央倉庫	6,500	1,082.00	7,033,000
川西倉庫	2,100	1,667.00	3,500,700
安田倉庫	9,100	885.00	8,053,500
東洋埠頭	3,100	1,529.00	4,739,900
宇徳	9,500	536.00	5,092,000
上組	67,300	2,428.00	163,404,400
サンリツ	2,700	681.00	1,838,700
キムラユニティー	3,000	1,138.00	3,414,000
キューソー流通システム	2,800	2,628.00	7,358,400
近鉄エクスプレス	20,600	1,832.00	37,739,200
東海運	5,900	304.00	1,793,600
エーアイティー	7,100	1,089.00	7,731,900
内外トランスライン	3,500	1,716.00	6,006,000
日本コンセプト	3,000	1,130.00	3,390,000
東京放送ホールディングス	74,900	2,050.00	153,545,000
日本テレビホールディングス	103,700	1,865.00	193,400,500
朝日放送グループホールディングス	11,300	804.00	9,085,200
テレビ朝日ホールディングス	31,000	2,292.00	71,052,000
スカパーJ S A Tホールディングス	86,300	536.00	46,256,800
テレビ東京ホールディングス	9,300	2,562.00	23,826,600
日本BS放送	3,900	1,247.00	4,863,300
ビジョン	3,500	4,340.00	15,190,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,300	1,121.00	4,820,300
ワイヤレスゲート	5,000	560.00	2,800,000
コネクシオ	8,000	1,604.00	12,832,000
日本通信	96,200	133.00	12,794,600
クロップス	2,100	780.00	1,638,000
日本電信電話	772,600	4,573.00	3,533,099,800
KDDI	995,500	2,466.50	2,455,400,750
光通信	13,300	19,110.00	254,163,000
NTTドコモ	811,100	2,550.00	2,068,305,000
エムティーアイ	13,200	589.00	7,774,800
GMOインターネット	41,100	1,662.00	68,308,200
アйдママーケティングコミュニケーション	2,300	557.00	1,281,100
カドカワ	32,900	1,373.00	45,171,700
学研ホールディングス	3,800	6,280.00	23,864,000
ゼンリン	22,500	2,750.00	61,875,000
昭文社	5,100	577.00	2,942,700
インプレスホールディングス	9,100	166.00	1,510,600
東京電力ホールディングス	918,900	598.00	549,502,200
中部電力	352,200	1,628.00	573,381,600
関西電力	469,700	1,819.50	854,619,150
中国電力	159,100	1,417.00	225,444,700

北陸電力	112,700	1,007.00	113,488,900
東北電力	269,600	1,447.00	390,111,200
四国電力	103,700	1,322.00	137,091,400
九州電力	237,300	1,330.00	315,609,000
北海道電力	107,700	696.00	74,959,200
沖縄電力	21,300	2,124.00	45,241,200
電源開発	91,600	2,981.00	273,059,600
エフオン	6,900	1,046.00	7,217,400
イーレックス	20,000	938.00	18,760,000
レノバ	11,900	1,292.00	15,374,800
東京瓦斯	225,800	2,847.50	642,965,500
大阪瓦斯	223,300	2,158.00	481,881,400
東邦瓦斯	57,000	4,300.00	245,100,000
北海道瓦斯	6,200	1,477.00	9,157,400
広島ガス	23,900	350.00	8,365,000
西部瓦斯	13,000	2,467.00	32,071,000
静岡ガス	35,400	1,004.00	35,541,600
メタウォーター	5,600	3,120.00	17,472,000
アイネット	6,400	1,626.00	10,406,400
松竹	7,500	11,280.00	84,600,000
東宝	74,300	3,710.00	275,653,000
エイチ・アイ・エス	19,600	3,600.00	70,560,000
東映	4,800	12,560.00	60,288,000
ラックランド	2,100	2,977.00	6,251,700
エヌ・ティ・ティ・データ	300,800	1,401.00	421,420,800
共立メンテナンス	16,800	5,390.00	90,552,000
イチネンホールディングス	11,500	1,514.00	17,411,000
建設技術研究所	7,600	1,587.00	12,061,200
スペース	7,200	1,251.00	9,007,200
長 大	4,400	888.00	3,907,200
アインホールディングス	15,200	8,810.00	133,912,000
燦ホールディングス	2,400	2,743.00	6,583,200
ピー・シー・エー	1,500	2,020.00	3,030,000
スバル興業	700	5,370.00	3,759,000
東京テアトル	4,300	1,332.00	5,727,600
タナベ経営	2,100	1,712.00	3,595,200
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,200.00	4,180,000
ナガワ	3,100	5,490.00	17,019,000
よみうりランド	2,400	4,140.00	9,936,000
東京都競馬	7,200	3,505.00	25,236,000
常盤興産	4,500	1,707.00	7,681,500
カナモト	15,500	4,120.00	63,860,000
東京ドーム	41,100	1,011.00	41,552,100
D T S	12,600	4,245.00	53,487,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,600	3,900.00	205,140,000
シーイーシー	12,100	2,414.00	29,209,400
カプコン	48,400	2,257.00	109,238,800
西尾レントオール	11,200	4,180.00	46,816,000
アイ・エス・ピー	2,200	2,289.00	5,035,800

アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	59,100	28.00	1,654,800	
日本空港ビルデング	36,200	4,215.00	152,583,000	
トランス・コスモス	12,200	2,580.00	31,476,000	
乃村工藝社	25,700	2,596.00	66,717,200	
ジャステック	6,600	1,117.00	7,372,200	
S C S K	29,800	4,690.00	139,762,000	
藤田観光	4,400	3,070.00	13,508,000	
K N T - C Tホールディングス	5,900	1,225.00	7,227,500	
日本管財	11,800	2,071.00	24,437,800	
トーカイ	10,600	2,578.00	27,326,800	
白洋舎	1,200	3,105.00	3,726,000	
セコム	116,700	9,085.00	1,060,219,500	
日本システムウエア	3,700	2,314.00	8,561,800	
セントラル警備保障	5,300	5,150.00	27,295,000	
アイネス	14,300	1,290.00	18,447,000	
丹青社	20,800	1,132.00	23,545,600	
メイテック	13,900	4,940.00	68,666,000	
T K C	9,500	4,135.00	39,282,500	
富士ソフト	16,900	5,540.00	93,626,000	
応用地質	11,800	1,336.00	15,764,800	
船井総研ホールディングス	22,800	2,308.00	52,622,400	
N S D	18,500	2,399.00	44,381,500	
進学会ホールディングス	4,900	559.00	2,739,100	
丸紅建材リース	1,100	2,195.00	2,414,500	
オオバ	8,700	696.00	6,055,200	
コナミホールディングス	46,200	5,050.00	233,310,000	
いであ	2,100	1,074.00	2,255,400	
学究社	3,700	1,696.00	6,275,200	
ベネッセホールディングス	40,300	3,205.00	129,161,500	
イオンディライト	13,500	4,005.00	54,067,500	
ナック	7,000	1,136.00	7,952,000	
福井コンピュータホールディングス	3,700	1,681.00	6,219,700	
ニチイ学館	15,700	1,154.00	18,117,800	
ダイセキ	18,400	2,815.00	51,796,000	
ステップ	4,100	1,659.00	6,801,900	
日鉄住金物産	8,100	5,310.00	43,011,000	
泉州電業	3,800	2,571.00	9,769,800	
元気寿司	3,200	5,470.00	17,504,000	
トラスコ中山	23,600	2,946.00	69,525,600	
ヤマダ電機	345,300	543.00	187,497,900	
オートバックスセブン	45,000	1,805.00	81,225,000	
モリト	8,300	882.00	7,320,600	
アーランドサカモト	19,200	1,564.00	30,028,800	
ニトリホールディングス	49,100	14,545.00	714,159,500	
グルメ杵屋	8,200	1,222.00	10,020,400	
愛眼	9,100	324.00	2,948,400	
ケーユーホールディングス	5,800	937.00	5,434,600	
吉野家ホールディングス	39,600	1,896.00	75,081,600	
加藤産業	17,700	3,495.00	61,861,500	

イノテック	7,800	1,314.00	10,249,200
イエローハット	10,700	2,925.00	31,297,500
松屋フーズホールディングス	5,500	3,735.00	20,542,500
JBCホールディングス	8,900	1,659.00	14,765,100
JKホールディングス	10,400	691.00	7,186,400
サガミホールディングス	15,200	1,380.00	20,976,000
日伝	9,400	1,795.00	16,873,000
関西スーパーマーケット	8,600	1,024.00	8,806,400
ミロク情報サービス	11,200	2,473.00	27,697,600
北沢産業	8,600	240.00	2,064,000
杉本商事	6,200	1,870.00	11,594,000
因幡電機産業	16,100	4,725.00	76,072,500
王将フードサービス	8,300	7,210.00	59,843,000
プレナス	12,700	1,877.00	23,837,900
ミニストップ	8,400	2,137.00	17,950,800
アークス	21,300	2,793.00	59,490,900
パローホールディングス	24,500	2,940.00	72,030,000
バイテックホールディングス	5,100	2,545.00	12,979,500
東テック	3,800	2,778.00	10,556,400
ミスミグループ本社	141,900	2,377.00	337,296,300
藤久	900	981.00	882,900
アルテック	8,100	273.00	2,211,300
ベルク	5,600	5,970.00	33,432,000
大 庄	6,100	1,714.00	10,455,400
タキヒヨー	3,500	1,937.00	6,779,500
ファーストリテイリング	15,200	60,800.00	924,160,000
ソフトバンクグループ	472,100	8,777.00	4,143,621,700
蔵王産業	1,900	1,477.00	2,806,300
スズケン	51,700	5,990.00	309,683,000
サンドラッグ	42,600	4,205.00	179,133,000
サックスパー ホールディングス	9,600	1,105.00	10,608,000
ジェコス	7,900	1,114.00	8,800,600
ヤマザワ	2,200	1,691.00	3,720,200
やまや	1,900	2,446.00	4,647,400
ルネサスイーストン	10,500	464.00	4,872,000
ベルーナ	27,800	1,193.00	33,165,400
合計	132,697,400		272,635,488,350

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘 柄	株 式 数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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。





## 「国内債券パッシブ・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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,988,775,800	10,671,441,201
国債証券		290,627,546,700	281,418,097,000
地方債証券		22,658,063,076	21,797,227,799
特殊債券		15,516,434,818	17,887,346,574
社債券		16,026,105,180	15,237,807,960
未収利息		809,938,365	736,262,657
前払費用		24,892,827	49,723,823
流動資産合計		347,651,756,766	347,797,907,014
資産合計		347,651,756,766	347,797,907,014
負債の部			
流動負債			
未払解約金		373,616,000	9,655,308,000
流動負債合計		373,616,000	9,655,308,000
負債合計		373,616,000	9,655,308,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	269,185,605,606	263,721,851,914
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		78,092,535,160	74,420,747,100
元本等合計		347,278,140,766	338,142,599,014
純資産合計		347,278,140,766	338,142,599,014
負債純資産合計		347,651,756,766	347,797,907,014

## 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	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
--------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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	282,771,174,063円	269,185,605,606円
同期中追加設定元本額	27,550,963,484円	69,271,978,218円
同期中一部解約元本額	41,136,531,941円	74,735,731,910円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	15,598,860,674円	17,408,404,294円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	124,116,436円	116,744,280円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	102,006,320円	90,125,269円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	30,584,053円	28,070,090円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	733,362,875円	808,008,087円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	216,723,104円	242,214,024円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	30,402,668円	34,579,469円
たわらノーロード 国内債券	3,595,522,441円	4,989,236,046円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	47,742,844円	137,544,608円
たわらノーロード バランス（堅実型）	10,353,709円	32,166,405円
たわらノーロード バランス（標準型）	17,145,514円	62,077,910円
たわらノーロード バランス（積極型）	4,141,838円	11,623,832円
たわらノーロード スマートグローバル	1,658,790円	5,379,624円
バランス（保守型）		
たわらノーロード スマートグローバル	29,546,022円	81,880,890円
バランス（安定型）		
たわらノーロード スマートグローバル	25,592,861円	111,554,132円
バランス（安定成長型）		
たわらノーロード スマートグローバル	6,916,307円	29,055,116円
バランス（成長型）		
たわらノーロード スマートグローバル	2,956,119円	15,002,139円
バランス（積極型）		
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,016,630円	1,295,989円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	579,598円	690,905円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	1,753,827円	3,474,718円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	559,116円	679,107円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	79,435円	17,517円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,607,384,154円	12,888,678,854円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	5,598,395,303円	5,907,177,396円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	8,135,597,016円	8,536,682,088円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,289,762,067円	3,449,028,586円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,808,465,812円	1,826,821,087円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,996,377,001円	2,023,278,584円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	306,027,282円	316,274,220円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	92,933,808円	88,374,891円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,325,174,416円	2,323,339,829円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,808,536円	2,827,451円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	490,583,551円	3,170,586,023円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	464,876,624円	749,121,254円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	110,016,730円	161,069,244円
投資のソムリエ	3,656,031,803円	8,284,268,559円
クルーズコントロール	2,834,062,140円	1,724,636,935円
投資のソムリエ<DC年金>	268,031,454円	733,113,467円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	1,980,355,404円	2,256,116,469円
DIAM DC バランス・F(成長型)	253,806,585円	286,051,968円
クルーズコントロール<DC年金>	1,114,497円	1,156,783円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,154,733円	4,671,623円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	19,225,839円	13,207,726円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	176,425,685円	996,404,083円
ダイナミック・ナビゲーション	1,755,737円	1,733,391円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,221,779,389円	18,251,393,459円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	627,563円	2,587,926円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	456,439円	1,888,453円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	855,190円	5,733,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	1,175,568円	3,709,153円

4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	26,234,067円	75,826,070円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	1,797,723,485円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	290,676円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	-円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券バシブファンド(適格機関投資家向け)	22,723,464,052円	22,705,000,385円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	485,649,448円	438,328,491円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	320,103,315円	272,739,106円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	243,509,098円	222,896,584円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	78,509,133円	70,267,221円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	222,528,168円	190,121,761円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	90,211,759円	80,778,823円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	54,372,232円	41,245,185円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	95,409,492円	89,222,117円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	174,179,313円	161,461,305円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,870,917,190円	5,444,421,012円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,129,834,212円	2,877,336,317円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,740,432,872円	5,340,448,902円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	618,042,639円	564,247,587円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	399,653,062円	258,167,248円
DIAM 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)	3,619,290,870円	3,303,558,731円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	2,324,817,852円	822,350,080円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	194,752,933円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	89,083,194円	44,645,422円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	787,267,774円	88,242,707円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	83,941,520,860円	55,525,240,297円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,130,706,610円	630,206,232円

D I A M世界アセットバランスファンド 2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	7,174,047,118円	6,958,172,222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 )	27,520,466,627円	26,484,173,718円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	79,617,622円	74,743,861円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	2,035,295円	1,402,145円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	7,738,785円	7,629,980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 )	30,635,457,140円	29,631,100,239円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機 関投資家限定 )	484,884,038円	457,580,297円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機 関投資家限定 )	135,640,228円	129,163,855円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	531,188,226円	508,066,309円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	715,639円	711,790円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	384,308円	381,210円
計	269,185,605,606円	263,721,851,914円
2 . 受益権の総数	269,185,605,606口	263,721,851,914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29年11月14日 至 平成30年5月11日	自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12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、価格変動リスク、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	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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)
国債証券	518,639,900	2,538,616,500
地方債証券	27,977,979	109,688,466
特殊債証券	22,865,043	126,749,519
社債証券	30,471,070	97,016,290
合計	437,325,808	2,872,070,775

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月15日から平成30年5月11日まで及び平成30年2月15日から平成30年11月12日まで)に対応する金額であります。

(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)

	平成30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.2901円	1.2822円
(1万口当たり純資産額)	(12,901円)	(12,822円)

## 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11月12日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	384回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,930,000	
	386回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,400,000	
	387回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,550,000	
	388回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,064,000	
	390回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,204,800,000	
	391回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,405,894,000	
	392回 利付国庫債券(2年)	1,800,000,000	1,807,956,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,008,430,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,010,110,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,208,624,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,013,350,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,512,900,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,230,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,212,892,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,420,000,000	2,435,221,800	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,020,070,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,034,584,400	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,180,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,460,000,000	2,479,975,200	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,805,107,600	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,118,333,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,210,800,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	620,287,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	440,000,000	595,878,800	
	4回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	856,648,800	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	915,103,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	896,595,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	917,047,500	
	8回 利付国庫債券(40年)	840,000,000	951,123,600	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	989,707,400	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	1,066,549,000	
	11回 利付国庫債券(40年)	490,000,000	457,160,200	
	305回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,523,910,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,531,290,000	
	307回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,427,314,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	818,536,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,019,960,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,531,740,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,037,799,000	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,261,886,000	

313回	利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,850,269,300
314回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	823,168,000
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,551,840,000
316回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	515,975,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,034,910,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,651,280,000
319回	利付国庫債券(10年)	600,000,000	622,686,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,050,000
321回	利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,141,019,000
322回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,033,930,000
323回	利付国庫債券(10年)	750,000,000	777,232,500
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,065,400,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,001,500,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,470,000
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,503,737,000
328回	利付国庫債券(10年)	2,390,000,000	2,462,512,600
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,363,319,700
330回	利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	2,033,577,000
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	671,528,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,545,017,600
333回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,589,900,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,950,000,000	3,060,241,500
335回	利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,323,980,000
336回	利付国庫債券(10年)	1,150,000,000	1,189,065,500
337回	利付国庫債券(10年)	1,650,000,000	1,685,854,500
338回	利付国庫債券(10年)	2,750,000,000	2,828,787,500
339回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,190,241,000
340回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,192,597,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,130,747,200
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,025,350,000
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,023,940,000
344回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,819,768,000
345回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,716,362,000
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,016,230,000
347回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,913,659,000
348回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,910,208,000
349回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,617,073,100
350回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,404,726,000
351回	利付国庫債券(10年)	2,740,000,000	2,740,000,000
352回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	998,530,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,955,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,662,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,692,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,224,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,778,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	254,056,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	378,912,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	239,890,000
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,668,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	374,118,000

13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	370,200,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	647,410,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,442,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	526,000,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,310,000	
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	540,787,800	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,748,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	396,954,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	387,822,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	623,534,900	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	796,692,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	398,988,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	519,080,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	921,193,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	935,550,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,205,838,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,191,600,000	
30回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,255,939,200	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,162,566,000	
32回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,262,860,800	
33回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,384,141,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	1,484,793,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,579,462,500	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,645,748,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,558,175,000	
38回	利付国庫債券(30年)	750,000,000	919,702,500	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	999,368,000	
40回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	797,979,000	
41回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	819,923,600	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	964,952,000	
43回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	723,966,000	
44回	利付国庫債券(30年)	780,000,000	941,467,800	
45回	利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,010,217,900	
46回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	1,137,946,600	
47回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,137,168,000	
48回	利付国庫債券(30年)	940,000,000	1,068,206,600	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,124,798,400	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	990,000,000	
51回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	805,742,700	
52回	利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	968,808,200	
53回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	843,219,000	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	887,688,000	
55回	利付国庫債券(30年)	830,000,000	817,624,700	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	885,465,000	
57回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	913,818,000	
58回	利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,108,914,200	
59回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	763,488,000	
60回	利付国庫債券(30年)	350,000,000	351,652,000	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	930,933,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	518,865,000	

47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	260,877,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	527,855,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	817,276,200	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	633,210,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	584,892,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	750,316,000	
55回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	439,093,600	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	646,524,000	
60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	626,444,300	
61回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	523,900,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	657,864,000	
65回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	605,621,500	
67回	利付国庫債券(20年)	520,000,000	574,990,000	
70回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	853,905,000	
72回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	394,278,500	
73回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	889,113,400	
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	500,082,000	
78回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	721,920,000	
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	273,451,200	
83回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	897,592,800	
85回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	508,266,000	
88回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	881,100,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,406,184,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,518,088,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	814,485,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	937,504,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,431,816,000	
97回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	594,475,000	
99回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,065,708,000	
100回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,017,195,000	
102回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	804,724,800	
105回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,134,803,500	
106回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	421,498,000	
107回	利付国庫債券(20年)	650,000,000	778,446,500	
108回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	883,237,500	
109回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	909,154,400	
110回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	900,855,000	
111回	利付国庫債券(20年)	570,000,000	692,641,200	
112回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	903,540,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,811,370,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,332,034,000	
115回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	855,288,000	
116回	利付国庫債券(20年)	740,000,000	906,736,800	
117回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,153,480,500	
118回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	843,801,000	
119回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	827,911,000	
120回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	695,622,000	
121回	利付国庫債券(20年)	730,000,000	873,167,600	
122回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	592,275,000	
123回	利付国庫債券(20年)	680,000,000	831,177,600	

1 2 4 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	605,265,000	
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	890,834,400	
1 2 6 回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	545,634,000	
1 2 7 回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	420,178,500	
1 2 8 回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,263,171,000	
1 2 9 回	利付国庫債券(20年)	200,000,000	238,158,000	
1 3 0 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,073,034,000	
1 3 1 回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	530,914,500	
1 3 2 回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	779,915,400	
1 3 3 回	利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,086,858,500	
1 3 4 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	597,785,000	
1 3 5 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	591,355,000	
1 3 6 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	584,920,000	
1 3 7 回	利付国庫債券(20年)	690,000,000	817,291,200	
1 3 8 回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	740,832,000	
1 3 9 回	利付国庫債券(20年)	580,000,000	678,965,400	
1 4 0 回	利付国庫債券(20年)	1,350,000,000	1,600,290,000	
1 4 1 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,304,809,000	
1 4 2 回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	899,760,000	
1 4 3 回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,137,974,900	
1 4 4 回	利付国庫債券(20年)	460,000,000	533,360,800	
1 4 5 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,663,676,000	
1 4 6 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,664,474,000	
1 4 7 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,762,605,000	
1 4 8 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,508,962,000	
1 4 9 回	利付国庫債券(20年)	1,520,000,000	1,765,510,400	
1 5 0 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,719,750,000	
1 5 1 回	利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,572,305,100	
1 5 2 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,559,880,000	
1 5 3 回	利付国庫債券(20年)	1,360,000,000	1,536,174,400	
1 5 4 回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,280,088,000	
1 5 5 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,349,525,000	
1 5 6 回	利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,340,627,200	
1 5 7 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,225,016,000	
1 5 8 回	利付国庫債券(20年)	1,330,000,000	1,317,045,800	
1 5 9 回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,428,150,800	
1 6 0 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,326,962,000	
1 6 1 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,200,996,000	
1 6 2 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,197,960,000	
1 6 3 回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,205,861,800	
1 6 4 回	利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,424,799,400	
1 6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,220,000,000	1,187,145,400	
1 6 6 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	403,160,000	
国債証券 合計		260,890,000,000	281,418,097,000	
地方債証券	6 8 0 回	東京都公募公債	200,000,000	203,692,000
	6 8 5 回	東京都公募公債	500,000,000	508,875,000
	6 8 8 回	東京都公募公債	200,000,000	203,400,000
	6 9 7 回	東京都公募公債	500,000,000	514,145,000
	7 0 1 回	東京都公募公債	700,000,000	719,313,000
	7 0 8 回	東京都公募公債	500,000,000	515,660,000

720回 東京都公募公債	300,000,000	311,655,000	
726回 東京都公募公債	400,000,000	414,164,000	
5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	112,926,000	
9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	235,188,000	
10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	351,546,000	
22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	205,616,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	309,420,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	308,208,000	
336回 大阪府公募公債	200,000,000	203,968,000	
345回 大阪府公募公債	300,000,000	307,881,000	
356回 大阪府公募公債	200,000,000	206,428,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	308,700,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	312,435,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	358,627,500	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,564,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	317,100,000	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	203,704,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	206,220,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	114,230,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	203,964,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	517,910,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	311,175,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	204,148,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,920,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	412,408,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,796,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	345,603,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	308,805,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	207,638,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,687,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,049,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,123,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,750,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,987,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,475,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,880,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	823,599,799	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,680,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,264,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,410,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,100,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,330,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,004,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,148,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,580,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,010,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	199,302,000	
488回 名古屋市長公募公債 10年	450,000,000	463,986,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	118,489,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	204,244,000	

	22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	205,180,000	
	23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	463,828,500	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	415,900,000	
	25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	207,030,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	102,589,000	
	21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	202,990,000	
	23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	206,580,000	
地方債証券 合計		21,043,900,000	21,797,227,799	
特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	200,580,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	212,382,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	267,822,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	720,363,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	103,254,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	186,774,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,583,000	
	18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	318,771,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	584,935,000	
	149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	412,636,000	
	180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,031,130,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	512,395,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,775,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	344,335,200	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,205,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	221,518,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	801,336,000	
	319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	198,184,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	530,548,000	
	1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,708,000	
	8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,764,000	
	10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,890,000	
	15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,630,000	
	20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,118,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,126,000	
	19回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	235,164,000	
	36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,888,000	
	44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	414,320,000	
	50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,505,000	
	56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	562,856,160	
	64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,159,000	
	44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	220,602,000	



15回	日本政策金融公庫債券	200,000,000	235,160,000		
39回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	238,284,000		
75回	住宅金融支援機構債券	350,000,000	419,615,000		
222回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,469,000		
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,022,000	46,301,459		
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,982,000	32,653,788		
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	46,317,000	48,847,297		
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,185,000	52,271,850		
13回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,843,000	18,368,833		
14回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	89,755,000	91,968,358		
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,495,000	17,457,483		
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,068,000	65,500,360		
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,674,000	49,204,664		
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,795,000	82,522,791		
29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,180,000	175,872,899		
36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,800,000	303,393,848		
126回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,057,000	288,290,326		
128回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,179,000	289,262,861		
131回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,238,000	292,701,374		
132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,553,000	292,986,442		
137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	299,337,000	299,977,581		
い第779号	利付商工債	200,000,000	200,464,000		
い第783号	利付商工債	300,000,000	300,963,000		
302回	利附信金中金債	300,000,000	300,615,000		
325回	利附信金中金債	400,000,000	399,748,000		
220号	利附商工債(3年)	300,000,000	300,000,000		
55回	鉄道建設運輸施設債	500,000,000	517,190,000		
特殊債券 合計		16,967,480,000	17,887,346,574		
社債券	1回	B P C E S A円貨社債(ソーシャル ボンド)	200,000,000	199,198,000	
	6回	クレディ・アグリコル・エス・エー円 貨社債	200,000,000	204,982,000	
	337回	東京交通債	200,000,000	210,274,000	
	27回	ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,756,000	
	22回	中日本高速道路債券	300,000,000	305,691,000	
	34回	政保西日本高速道路債券	200,000,000	201,784,000	
	9回	日本たばこ産業社債	200,000,000	200,540,000	
	19回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,372,000	
	6回	J Xホールディングス社債	100,000,000	104,234,000	
	23回	ジェイ エフ イー ホールディ ングス社債	100,000,000	99,767,000	
	30回	豊田自動織機社債	200,000,000	199,880,000	
	12回	パナソニック社債	200,000,000	200,840,000	
	13回	パナソニック社債	100,000,000	101,470,000	
	56回	日産自動車社債	100,000,000	100,618,000	
	14回	トヨタ自動車社債	200,000,000	207,342,000	
	16回	トヨタ自動車社債	200,000,000	205,306,000	
94回	丸紅社債	100,000,000	103,764,000		

45回	住友商事社債	100,000,000	103,176,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	103,016,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,485,000	
57回	東京三菱銀行社債	200,000,000	216,536,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,480,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	204,832,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,244,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	311,460,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,616,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	204,736,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	103,802,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,539,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,164,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	102,974,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	204,986,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	412,644,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	206,144,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,364,000	
14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,659,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,725,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	203,626,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,628,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	203,830,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	112,128,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	100,985,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,097,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,493,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,434,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	336,930,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,198,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	214,762,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,801,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,153,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,529,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	312,873,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	219,170,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,993,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	139,622,400	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	307,737,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	510,230,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,458,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	417,060,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	303,657,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	103,489,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,142,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,300,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	418,236,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	303,597,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	207,214,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	210,136,000	

4 2 6 回 九州電力社債	400,000,000	417,192,000	
3 2 0 回 北海道電力社債	200,000,000	202,602,000	
3 2 1 回 北海道電力社債	161,000,000	166,467,560	
3 4 0 回 北海道電力社債	300,000,000	300,978,000	
1 3 回 電源開発社債	200,000,000	222,446,000	
3 8 回 電源開発社債	300,000,000	310,995,000	
2 3 回 東京瓦斯社債	300,000,000	312,282,000	
1 8 回 大阪ガス社債	100,000,000	105,556,000	
2 7 回 N T T データ社債	100,000,000	103,381,000	
社債券 合計	14,681,000,000	15,237,807,960	
合計	313,582,380,000	336,340,479,333	

## 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。

## 「J-REITインデックスファンド・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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		546,669,355	1,701,032,743
投資証券		34,917,908,695	31,472,460,490
派生商品評価勘定		29,819,992	16,985,592
未収入金		679,730	-
未収配当金		299,234,506	298,443,790
差入委託証拠金		10,316,592	10,492,092
流動資産合計		35,804,628,870	33,499,414,707
資産合計		35,804,628,870	33,499,414,707
負債の部			
流動負債			
前受金		28,415,992	9,263,592
未払金		75,926,386	914,711,606
未払解約金		3,932,600	370,110,400
流動負債合計		108,274,978	1,294,085,598
負債合計		108,274,978	1,294,085,598
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,649,416,832	16,951,549,055
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		16,046,937,060	15,253,780,054
元本等合計		35,696,353,892	32,205,329,109
純資産合計		35,696,353,892	32,205,329,109
負債純資産合計		35,804,628,870	33,499,414,707

## 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	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。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3 . 収益及び費用の計上基準	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。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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	21,317,986,006円	19,649,416,832円
同期中追加設定元本額	7,818,240,858円	8,074,457,497円
同期中一部解約元本額	9,486,810,032円	10,772,325,274円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	336,199円	280,843円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	878,816円	1,025,234円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,268,214円	2,030,344円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,960,395円	1,911,261円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,801,841円	2,803,635円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,493,917円	2,454,496円
たわらノーロード 国内リート	1,209,652,777円	1,598,347,549円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	337,646,675円	637,901,090円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	35,636,566円	97,030,025円
たわらノーロード バランス（堅実型）	417,541円	1,229,846円
たわらノーロード バランス（標準型）	7,444,866円	25,399,955円
たわらノーロード バランス（積極型）	15,427,431円	41,185,845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）	4,154,979円	11,498,642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）	8,924,445円	41,640,627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）	5,589,764円	25,341,445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)	11,835,060円	53,823,143円
たわらノーロード 最適化バランス(安 定型)	135,622円	167,960円
たわらノーロード 最適化バランス(安 定成長型)	813,152円	1,644,501円
たわらノーロード 最適化バランス(成 長型)	752,690円	937,935円
たわらノーロード 最適化バランス(積 極型)	2,177,723円	2,888,276円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配 型>	14,719,897円	14,015,062円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	368,359,319円	368,084,557円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	3,505,986円	2,122,432円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	18,269,982円	113,081,002円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	64,395,954円	98,264,882円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	141,346,196円	196,760,052円
投資のソムリエ	2,670,186,923円	1,496,921,002円
投資のソムリエ<DC年金>	193,635,682円	132,450,424円
D I A M 8資産バランスファンドN< DC年金>	74,022,355円	80,069,705円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制 型	76,829,494円	41,057,145円
ダイナミック・ナビゲーション	546,439円	449,217円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,372,205,075円	751,303,077円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 045)	452,782円	766,234円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 055)	333,150円	559,491円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	369,640円	235,489円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 035)	862,712円	1,105,464円
リスクコントロール世界資産分散ファン ド	- 円	255,955,063円
9資産分散投資・スタンダード<DC年 金>	- 円	8,057円
Jリートインデックスファンド(DC)	7,449,119円	6,756,162円
D I A M J - R E I Tインデックス私 募ファンド201212(適格機関投資 家限定)	92,454,450円	90,731,870円
D I A M J - R E I Tインデックス私 募ファンド201401(適格機関投資 家限定)	835,168,534円	819,808,744円
D I A M J - R E I Tインデックス ファンド(適格機関投資家向け)	9,926,407,294円	8,539,147,794円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重 視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投 資家限定)	- 円	63,083,346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)	14,402,370円	14,402,370円
	D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,187,943,032円	856,564,973円
	D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	934,201,774円	458,302,789円
	計	19,649,416,832円	16,951,549,055円
2.	受益権の総数	19,649,416,832口	16,951,549,055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29年11月14日 至 平成30年5月11日	自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12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、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、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。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。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、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。	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	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	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30年5月11日現在	平成30年11月12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）
投資証券	489,722,335	744,410,468
合計	489,722,335	744,410,468

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月7日から平成30年5月11日まで及び平成30年6月7日から平成30年11月12日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 不動産投信関連

種類	平成30年5月11日 現在				平成30年11月12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								
不動産投信指数先物取引								
買 建	579,127,100	-	608,985,000	29,857,900	607,932,000	-	624,955,500	17,023,500
合計	579,127,100	-	608,985,000	29,857,900	607,932,000	-	624,955,500	17,023,500

## （注）1．時価の算定方法

不動産投信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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.8167円	1.8998円
（1万口当たり純資産額）	（18,167円）	（18,998円）

## 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11月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CRE ロジスティクスファンド投資法人	362	38,444,400	
	GLP 投資法人	8,962	1,009,121,200	
	MCUBS MidCity 投資法人	4,076	355,427,200	
	One リート投資法人	527	133,172,900	
	いちごオフィスリート投資法人	3,001	280,893,600	
	いちごホテルリート投資法人	632	85,636,000	
	さくら総合リート投資法人	783	69,217,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,733	840,505,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,525	1,048,335,000	
	イオンリート投資法人	3,712	469,196,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	21,439	347,526,190	
	インヴィンシブル投資法人	12,657	587,284,800	
	オリックス不動産投資法人	7,206	1,278,344,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,312	266,804,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,119	811,275,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,146	370,399,600	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,326	320,759,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,379	378,121,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	724	65,304,800	
	ザイマックス・リート投資法人	334	38,176,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,472	841,948,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,239	481,639,300	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,617	2,202,753,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,123	119,487,200	
	スターツプロシード投資法人	570	96,159,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	541	48,581,800	
	トーセイ・リート投資法人	696	76,003,200	
	ヒューリックリート投資法人	2,924	480,705,600	
	フロンティア不動産投資法人	1,230	543,660,000	
	プレミア投資法人	3,439	422,309,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	479	53,791,700	
	マリモ地方創生リート投資法人	311	33,899,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,977	1,415,119,800	
	ラサールロジポート投資法人	2,728	291,896,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	559	51,260,300		
阪急阪神リート投資法人	1,500	218,250,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	617	206,386,500		
三菱地所物流リート投資法人	383	97,090,500		

産業ファンド投資法人	4,214	476,603,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	849	118,605,300	
森トラスト総合リート投資法人	2,585	420,062,500	
森ヒルズリート投資法人	4,148	577,816,400	
星野リゾート・リート投資法人	550	295,350,000	
積水ハウス・リート投資法人	9,332	660,705,600	
大江戸温泉リート投資法人	584	50,749,600	
大和ハウスリート投資法人	4,528	1,121,585,600	
大和証券オフィス投資法人	835	602,035,000	
投資法人みらい	974	179,021,200	
東急リアル・エステート投資法人	2,425	391,395,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,202	629,848,000	
日本ビルファンド投資法人	3,502	2,377,858,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,289	951,079,500	
日本プロロジスリート投資法人	4,851	1,160,359,200	
日本ヘルスケア投資法人	166	28,684,800	
日本リート投資法人	1,167	430,623,000	
日本リテールファンド投資法人	6,836	1,467,005,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,386	544,962,400	
日本賃貸住宅投資法人	4,068	366,120,000	
福岡リート投資法人	1,870	317,526,000	
平和不動産リート投資法人	2,252	256,953,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	10,720	1,572,624,000	
投資証券 合計	192,693	31,472,460,490	
合計	192,693	31,472,460,490	

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。

## 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。

## 「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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,401,236,841	14,071,421,661
コール・ローン		269,384,127	315,010,360
株式		295,190,008,471	324,188,852,487
投資信託受益証券		854,838,833	769,657,882
投資証券		6,319,053,365	7,506,660,447
派生商品評価勘定		179,300,225	231,402,417
未収入金		12,573,545	216,152,318
未収配当金		503,986,367	384,803,080
差入委託証拠金		2,345,484,087	2,179,103,470
流動資産合計		309,075,865,861	349,863,064,122
資産合計		309,075,865,861	349,863,064,122
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		316,706	15,095,019
未払金		-	14,030,089,521
未払解約金		194,297,000	99,795,000
流動負債合計		194,613,706	14,144,979,540
負債合計		194,613,706	14,144,979,540
純資産の部			
元本等			
元本	1	89,187,362,436	94,537,119,407
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		219,693,889,719	241,180,965,175
元本等合計		308,881,252,155	335,718,084,582
純資産合計		308,881,252,155	335,718,084,582
負債純資産合計		309,075,865,861	349,863,064,122

## 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	<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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<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>
3. 収益及び費用の計上基準	<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>
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>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30年5月11日現在	平成30年11月12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	87,684,015,440円	89,187,362,436円
同期中追加設定元本額	14,438,554,232円	18,216,257,955円
同期中一部解約元本額	12,935,207,236円	12,866,500,984円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M 外国株式パッシブ・ファンド	2,243,257,241円	2,720,697,179円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,658,946円	2,913,395円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,253,521円	8,567,971円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	15,893,239円	16,971,755円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,705,207円	20,140,771円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,780,776円	23,048,530円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,817,157円	20,870,949円
たわらノーロード 先進国株式	6,456,673,722円	8,051,172,132円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	424,449円	424,170円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	663,110,499円	995,586,600円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	18,864,250円	51,785,996円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,319,614円	4,032,356円
たわらノーロード バランス(標準型)	10,557,940円	37,015,213円
たわらノーロード バランス(積極型)	25,055,924円	68,064,714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)	56,458円	230,259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)	5,779,872円	16,659,542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)	10,915,519円	50,346,140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)	7,112,866円	35,591,158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)	17,833,120円	87,681,588円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,504円	16,688円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	55,936円	70,914円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	395,874円	818,607円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	424,921円	611,066円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,461,166円	2,265,459円
DIAM外国株式インデックスファンド <DC年金>	38,235,165,998円	39,988,448,170円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >1安定型	165,489,803円	163,973,370円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >2安定・成長型	868,941,508円	847,268,707円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >3成長型	1,083,993,923円	1,064,743,402円
DIAM DC バランス30インデックス ファンド	131,919,721円	123,860,732円
DIAM DC バランス50インデックス ファンド	384,231,018円	357,317,417円
DIAM DC バランス70インデックス ファンド	337,185,434円	319,991,400円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,943,791円	30,441,363円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	799,032,499円	798,569,617円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	206,676,091円	213,664,955円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	32,905,240円	202,174,693円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	85,724,709円	131,242,647円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	167,600,179円	229,321,951円
投資のソムリエ	572,789,502円	1,605,577,084円
クルーズコントロール	551,917,471円	312,816,573円
投資のソムリエ<DC年金>	41,349,986円	141,994,003円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	132,990,486円	145,968,090円
D I A M D C バランス・F(成長型)	83,137,087円	87,368,398円
クルーズコントロール<DC年金>	217,111円	209,742円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	2,390,859円	1,695,605円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	7,484,466円	4,809,870円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	27,919,504円	17,837,126円
ダイナミック・ナビゲーション	382,109円	1,324,764円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	489,994,110円	330,369,754円
ワールドアセットバランス(基本コース)	679,300,871円	595,681,660円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,746,193,982円	1,450,991,635円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	289,507円	1,657,234円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	214,563円	1,210,777円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	132,362円	101,888円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	186,396円	2,371,748円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,910,005円	5,289,055円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	93,812,225円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	13,989円
D I A M外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	91,850,900円	91,075,475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)	2,888,682,718円	2,860,923,249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)	161,094,460円	5,982,967,603円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	208,717,363円	206,217,109円



D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	24,032,692円	21,401,209円
D I A Mグローバル・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	101,302,777円	85,262,542円
D I A Mグローバル・バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	231,366,539円	209,233,430円
D I A M国際分散バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	12,774,196円	11,291,903円
D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	84,522,643円	71,339,508円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	6,847,227円	6,051,680円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	10,322,970円	7,734,968円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	24,154,580円	22,311,659円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	66,158,499円	60,585,194円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	557,068,787円	510,360,381円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	693,307,462円	629,658,009円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,180,387,090円	2,003,920,518円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	785,015,691円	709,013,146円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	181,769,680円	117,150,494円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	916,000,032円	826,292,348円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	293,981,445円	102,616,266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)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	50,770,727円	25,236,110円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	149,315,466円	16,249,487円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	7,967,904,412円	5,206,864,752円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	429,484,114円	236,507,098円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,361,926,844円	1,304,871,608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)	5,225,242,038円	4,967,324,311円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	18,843,968円	17,489,143円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	1,236,246円	840,169円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	10,773,604円	10,354,542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 )	6,979,894,530円	6,669,377,978円
D I A Mバランス20 V A ( 適格機関投 資家限定 )	60,336,899円	55,662,387円
D I A Mバランス40 V A ( 適格機関投 資家限定 )	233,071円	223,728円
D I A Mバランス60 V A ( 適格機関投 資家限定 )	262,779円	253,632円
計	89,187,362,436円	94,537,119,407円
2 . 受益権の総数	89,187,362,436口	94,537,119,407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29年11月14日 至 平成30年5月11日	自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12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、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。 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。	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30年5月11日現在	平成30年11月12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等は、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30年5月11日現在	平成30年11月12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	6,221,708,919	2,668,156,337
投資信託受益証券	52,750,239	38,589,778
投資証券	280,138,908	488,316,437
合計	6,554,598,066	3,195,062,552

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月16日から平成30年5月11日まで及び平成30年2月16日から平成30年11月12日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成30年5月11日 現在				平成30年11月12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								
買 建	94,611,279	-	94,385,540	225,739	7,185,086,580	-	7,184,340,480	746,100
アメリカ・ドル	76,824,300	-	76,622,000	202,300	4,917,194,450	-	4,916,688,210	506,240
イギリス・ポンド	8,612,739	-	8,586,050	26,689	451,741,155	-	451,719,700	21,455
オーストラリア・ドル	824,030	-	823,900	130	153,583,050	-	153,534,480	48,570
カナダ・ドル	2,485,851	-	2,485,590	261	248,927,730	-	248,889,390	38,340
シンガポール・ドル	-	-	-	-	74,367,000	-	74,349,000	18,000
スイス・フラン	-	-	-	-	433,788,481	-	433,824,100	35,619
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	155,446,400	-	155,496,000	49,600
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	82,127,025	-	82,127,500	475
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	65,497,795	-	65,426,500	71,295
ユーロ	5,864,359	-	5,868,000	3,641	436,549,194	-	436,529,600	19,594
香港・ドル	-	-	-	-	165,864,300	-	165,756,000	108,300
合計	94,611,279	-	94,385,540	225,739	7,185,086,580	-	7,184,340,480	746,100

## (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ではありません。

## 株式関連

種類	平成30年5月11日 現在				平成30年11月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	6,140,064,901	-	6,319,274,159	179,209,258	9,979,170,442	-	10,196,223,940	217,053,498
合計	6,140,064,901	-	6,319,274,159	179,209,258	9,979,170,442	-	10,196,223,940	217,053,498

## (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ではありません。

## (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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	3.4633円	3.5512円
(1万口当たり純資産額)	(34,633円)	(35,512円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年11月12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	33,435	1,712.430	57,255,097.050	
	ABBOTT LABORATORIES	142,085	72.790	10,342,367.150	
	AES CORP	55,631	15.520	863,393.120	
	ABIOMED INC	3,560	405.170	1,442,405.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,396	123.540	9,190,881.840	
	ADVANCED MICRO DEVICES	76,385	21.030	1,606,376.550	
	ADOBE INC	39,997	244.840	9,792,865.480	
	CHUBB LTD	37,075	131.170	4,863,127.750	
	AGCO CORP	5,610	55.780	312,925.800	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,682	159.900	2,827,351.800	
	ALLEGHANY CORP	1,325	628.990	833,411.750	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	123.930	606,389.490	
	ALLSTATE CORP	28,558	93.720	2,676,455.760	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	60,042	150.320	9,025,513.440	
	AMGEN INC	53,734	193.160	10,379,259.440	
	HESS CORP	23,734	59.150	1,403,866.100	
	AMERICAN EXPRESS CO	59,108	108.280	6,400,214.240	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,528	75.320	2,977,248.960	
	AFLAC INC	62,351	45.040	2,808,289.040	
	AMERICAN INTL GROUP	73,452	43.820	3,218,666.640	
	AMERCO	551	335.540	184,882.540	
	ANALOG DEVICES	30,662	87.590	2,685,684.580	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,877	58.210	2,495,870.170	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,964	123.440	2,217,476.160	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	76,484	34.350	2,627,225.400	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	140.020	572,261.740	
	VALERO ENERGY CORP	35,375	87.580	3,098,142.500	
	APACHE CORP	30,595	37.080	1,134,462.600	
	ANSYS INC	6,519	165.860	1,081,241.340	
	APPLE INC	398,277	204.470	81,435,698.190	
	APPLIED MATERIALS INC	82,917	34.280	2,842,394.760	
	ALBEMARLE CORP	7,904	102.380	809,211.520	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,485	48.260	2,195,106.100		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	88.470	849,312.000		
AMEREN CORP	22,239	67.320	1,497,129.480		

ARROW ELECTRONICS INC	8,346	74.330	620,358.180	
AUTOLIV INC	6,197	81.750	506,604.750	
AUTODESK INC	18,045	135.550	2,445,999.750	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,703	147.190	5,255,124.570	
AUTOZONE INC	2,231	793.870	1,771,123.970	
AVERY DENNISON CORP	6,262	92.000	576,104.000	
AVNET INC	10,288	43.660	449,174.080	
BALL CORP	27,803	48.680	1,353,450.040	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	103,466	219.630	22,724,237.580	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	80,602	48.500	3,909,197.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,327	63.480	2,686,917.960	
BECTON DICKINSON & CO	21,205	243.260	5,158,328.300	
AMETEK INC	20,976	74.450	1,561,663.200	
VERIZON COMM INC	334,688	58.460	19,565,860.480	
WR BERKLEY CORP	8,134	78.410	637,786.940	
BEST BUY CO INC	19,210	67.790	1,302,245.900	
YUM! BRANDS INC	26,223	90.720	2,378,950.560	
FIRSTENERGY CORP	35,496	38.000	1,348,848.000	
H&R BLOCK INC	16,114	28.730	462,955.220	
BOEING CO	44,865	369.340	16,570,439.100	
ROBERT HALF INTL INC	10,827	62.840	680,368.680	
BORGWARNER INC	14,648	38.790	568,195.920	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	111,108	38.600	4,288,768.800	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	89.610	1,053,365.550	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	113.050	987,039.550	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	608.030	1,302,400.260	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,989	53.390	7,100,282.710	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	115.240	436,529.120	
INGREDION INC	5,305	104.750	555,698.750	
ONEOK INC	34,002	63.090	2,145,186.180	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	106.490	628,291.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	126.670	802,074.440	
SEMPRA ENERGY	20,552	116.700	2,398,418.400	
FEDEX CORP	20,262	224.400	4,546,792.800	
VERISIGN INC	9,648	160.100	1,544,644.800	
AMPHENOL CORP	23,100	91.140	2,105,334.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	48.920	962,892.360	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.210	789,241.320	
CSX CORP	67,600	70.660	4,776,616.000	
CABOT OIL & GAS CORP	38,255	25.610	979,710.550	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	38.970	547,528.500	



SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	43.030	886,977.390	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,698	203.130	2,782,474.740	
CARDINAL HEALTH INC	26,919	55.310	1,488,889.890	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,448	58.540	2,075,125.920	
CATERPILLAR INC	48,596	126.910	6,167,318.360	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	112.640	1,107,476.480	
CELGENE CORP	59,464	74.020	4,401,525.280	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	107.010	1,165,980.960	
CENTURYLINK INC	80,424	18.910	1,520,817.840	
CERNER CORP	22,947	57.570	1,321,058.790	
JPMORGAN CHASE & CO	275,151	111.290	30,621,554.790	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	65.550	1,233,782.100	
CIGNA CORP	19,268	217.650	4,193,680.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,286	81.320	1,161,737.520	
CINTAS CORP	7,944	179.220	1,423,723.680	
CISCO SYSTEMS INC	380,766	47.110	17,937,886.260	
CLOROX COMPANY	10,885	158.770	1,728,211.450	
COCA-COLA CO/THE	325,562	49.680	16,173,920.160	
COPART INC	15,900	50.270	799,293.000	
COGNEX CORP	15,291	45.060	689,012.460	
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,691	63.800	4,318,685.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	24,763	117.040	2,898,261.520	
COMERICA INC	15,393	84.690	1,303,633.170	
COMCAST CORP-CL A	373,074	38.340	14,303,657.160	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	34.390	1,395,305.470	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,350	79.000	1,844,650.000	
CMS ENERGY CORP	23,616	50.140	1,184,106.240	
COOPER COS INC	3,794	267.800	1,016,033.200	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	64.500	1,044,900.000	
CORNING INC	68,691	33.560	2,305,269.960	
SEALED AIR CORP	13,870	35.100	486,837.000	
CUMMINS INC	13,193	143.070	1,887,522.510	
DR HORTON INC	32,152	34.400	1,106,028.800	
DANAHER CORP	51,071	104.390	5,331,301.690	
MOODY'S CORP	14,293	153.500	2,193,975.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,741	70.340	3,358,101.940	
TARGET CORP	40,408	86.940	3,513,071.520	
DEERE & CO	24,482	144.810	3,545,238.420	
MORGAN STANLEY	107,976	45.730	4,937,742.480	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	74.740	1,298,607.500	
COSTAR GROUP INC	2,786	365.010	1,016,917.860	
THE WALT DISNEY CO	120,445	118.000	14,212,510.000	
DOLLAR TREE INC	20,078	86.380	1,734,337.640	
DOVER CORP	12,635	86.420	1,091,916.700	

OMNICOM GROUP	19,325	75.570	1,460,390.250	
DTE ENERGY CO	14,643	118.140	1,729,924.020	
DUKE ENERGY CORP	56,007	85.580	4,793,079.060	
FLOWSERVE CORP	8,406	50.220	422,149.320	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	112.440	1,060,983.840	
EBAY INC	78,355	29.630	2,321,658.650	
BANK OF AMERICA CORP	779,252	28.520	22,224,267.040	
CITIGROUP INC	205,990	65.760	13,545,902.400	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,358	82.820	1,106,309.560	
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,829	52.940	1,261,507.260	
EATON CORP PLC	35,649	73.430	2,617,706.070	
EATON VANCE CORP	9,184	44.180	405,749.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	46.260	965,770.020	
DISH NETWORK CORP	16,150	31.730	512,439.500	
ECOLAB INC	20,640	159.330	3,288,571.200	
ELECTRONIC ARTS INC	25,240	88.890	2,243,583.600	
SALESFORCE.COM INC	57,341	136.920	7,851,129.720	
EMERSON ELECTRIC CO	51,077	68.490	3,498,263.730	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	96.690	794,888.490	
ENERGY CORP	13,599	85.560	1,163,530.440	
EOG RESOURCES INC	46,971	105.510	4,955,910.210	
EQUIFAX INC	10,231	102.120	1,044,789.720	
EQT CORP	20,049	35.900	719,759.100	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,295	140.230	2,565,507.850	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	71.730	1,061,030.160	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	44,474	98.480	4,379,799.520	
EXXON MOBIL CORP	342,659	80.870	27,710,833.330	
FMC CORP	10,614	83.570	887,011.980	
NEXTERA ENERGY INC	37,752	176.560	6,665,493.120	
ASSURANT INC	4,089	104.780	428,445.420	
FASTENAL CO	21,654	54.760	1,185,773.040	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	27.960	1,458,757.080	
M&T BANK CORP	10,399	166.720	1,733,721.280	
FISERV INC	33,307	80.240	2,672,553.680	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	48.400	562,553.200	
MACY'S INC	24,741	37.780	934,714.980	
FORD MOTOR CO	304,939	9.380	2,860,327.820	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,330	30.870	998,027.100	
FREEMPORT-MCMORAN INC	117,269	11.350	1,331,003.150	
FLEX LTD	35,913	8.220	295,204.860	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,478	78.050	1,286,107.900	
GAP INC/THE	18,295	27.480	502,746.600	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	36.060	630,220.620	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,649	184.500	3,809,740.500	
GENERAL MILLS INC	48,902	45.310	2,215,749.620	
GENUINE PARTS CO	11,759	100.610	1,183,072.990	
GILEAD SCIENCES INC	105,995	71.180	7,544,724.100	
GARTNER INC	7,153	147.640	1,056,068.920	

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	21.990	397,953.030	
MCKESSON CORP	16,848	130.810	2,203,886.880	
NVIDIA CORP	46,836	205.670	9,632,760.120	
GENERAL ELECTRIC CO	707,684	8.580	6,071,928.720	
WW GRAINGER INC	3,832	293.750	1,125,650.000	
HALLIBURTON CO	73,763	34.980	2,580,229.740	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,522	56.840	1,848,550.480	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,090	222.650	6,476,888.500	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	40.730	525,457.730	
HARRIS CORP	10,033	153.140	1,536,453.620	
HASBRO INC	9,136	97.320	889,115.520	
HENRY SCHEIN INC	11,426	85.430	976,123.180	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	62.590	629,342.450	
HERSHEY FOODS CORP	12,522	108.580	1,359,638.760	
HP INC	133,588	25.000	3,339,700.000	
F5 NETWORKS INC	4,874	183.240	893,111.760	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	45.790	479,512.880	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	114.390	394,302.330	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	29.120	807,788.800	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	64.700	812,049.700	
HOLOGIC INC	23,377	41.780	976,691.060	
UNUM GROUP	16,000	37.710	603,360.000	
HOME DEPOT INC	93,569	185.990	17,402,898.310	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	95.670	1,442,607.930	
HORMEL FOODS CORP	24,161	45.020	1,087,728.220	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,790	28.130	1,259,942.700	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,569	211.750	755,735.750	
HUMANA INC	11,262	338.950	3,817,254.900	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	106.720	785,352.480	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,648	14.670	1,373,816.160	
RED HAT INC	14,824	173.750	2,575,670.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	34.020	408,240.000	
BIOGEN INC	17,276	325.200	5,618,155.200	
IDEX CORP	5,924	135.530	802,879.720	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,911	132.560	3,302,202.160	
INTUIT INC	19,317	222.170	4,291,657.890	
IDEXX LABORATORIES INC	7,402	207.170	1,533,472.340	
INGERSOLL-RAND PLC	20,370	102.860	2,095,258.200	
INTEL CORP	377,745	48.110	18,173,311.950	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,446	145.850	1,085,999.100	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	46.220	1,524,474.260	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	23.840	695,102.880	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	77.250	743,994.750	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	141.500	837,538.500	
INCYTE CORP	15,601	66.030	1,030,134.030	
JOHNSON & JOHNSON	217,173	145.340	31,563,923.820	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	46.590	1,371,656.190	
KLA-TENCOR CORP	11,724	95.280	1,117,062.720	
DEVON ENERGY CORP	44,878	33.010	1,481,422.780	
KELLOGG CO	21,564	65.010	1,401,875.640	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	54.000	594,000.000	
KEYCORP	88,511	18.890	1,671,972.790	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,662	109.450	3,137,055.900	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,584	413.950	3,967,296.800	
KOHL'S CORP	14,910	81.970	1,222,172.700	
KROGER CO	66,610	31.390	2,090,887.900	
LAM RESEARCH CORP	13,737	147.850	2,031,015.450	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	96.000	677,472.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	70.940	895,404.680	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	37.570	360,221.160	
LENNAR CORP	21,933	41.900	918,992.700	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	21.990	471,949.380	
ELI LILLY & CO	79,368	112.210	8,905,883.280	
L BRANDS INC	16,262	36.500	593,563.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,890	65.080	1,229,361.200	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,869	109.510	6,118,214.190	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	67.270	1,693,522.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	313.120	6,540,137.440	
LOEWS CORP	21,346	49.590	1,058,548.140	
LOWE'S COS INC	66,935	96.820	6,480,646.700	
DOMINION ENERGY INC	52,247	72.250	3,774,845.750	
SCANA CORP	10,902	40.180	438,042.360	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	25.540	1,029,210.920	
MCCORMICK & CO INC	9,307	150.400	1,399,772.800	
MCDONALD'S CORPORATION	63,614	185.940	11,828,387.160	
S&P GLOBAL INC	20,081	186.270	3,740,487.870	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	221.220	631,583.100	
MANPOWERGROUP INC	6,265	79.610	498,756.650	
MARKEL CORPORATION	1,258	1,121.990	1,411,463.420	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,378	153.180	2,661,962.040	
MARSH & MCLENNAN COS	41,255	87.760	3,620,538.800	
MASCO CORP	23,043	31.030	715,024.290	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	184.290	991,848.780	
MATTEL INC	24,003	13.550	325,240.650	
METLIFE INC	70,638	45.190	3,192,131.220	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,490	52.090	1,327,774.100	
MEDTRONIC PLC	109,722	94.360	10,353,367.920	
ACTIVISION BLIZZARD INC	59,081	55.010	3,250,045.810	
CVS HEALTH CORP	82,940	79.830	6,621,100.200	
MERCK & CO. INC.	217,964	74.860	16,316,785.040	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	17.880	570,372.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,999	170.150	1,531,179.850	
MICROSOFT CORP	591,025	109.570	64,758,609.250	
MICRON TECH INC	94,810	39.110	3,708,019.100	
MIDDLEBY CORP	4,100	117.690	482,529.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	72.130	1,264,366.770	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	45,086	16.390	738,959.540	
3M CO	48,086	201.100	9,670,094.600	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	125.650	612,292.450	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,480	129.650	1,747,682.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	102.420	907,031.520	
MYLAN NV	43,574	36.950	1,610,059.300	
ILLUMINA INC	12,036	329.250	3,962,853.000	
XCEL ENERGY INC	41,218	50.340	2,074,914.120	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	35.260	1,180,081.680	
NETAPP INC	20,587	81.660	1,681,134.420	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	21.830	299,944.200	
NEWELL BRANDS INC	36,206	19.900	720,499.400	
NEWMONT MINING CORP	48,693	32.020	1,559,149.860	
NVR INC	307	2,315.050	710,720.350	
NIKE INC-CL B	104,293	76.360	7,963,813.480	
NOBLE ENERGY INC	36,582	26.520	970,154.640	
NORDSTROM INC	9,487	65.460	621,019.020	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,077	170.320	3,930,474.640	
EVERSOURCE ENERGY	27,088	65.140	1,764,512.320	
NISOURCE INC	31,548	26.160	825,295.680	
TAPESTRY INC	22,269	42.000	935,298.000	
NORTHERN TRUST CORP	17,867	97.940	1,749,893.980	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,299	285.730	3,799,923.270	
WELLS FARGO & CO	374,611	53.040	19,869,367.440	
NUCOR CORP	23,780	62.780	1,492,908.400	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	62.350	993,048.450	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,049	90.400	3,530,029.600	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,379	73.550	4,514,425.450	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	134.990	663,745.830	
OGE ENERGY CORP	16,028	38.230	612,750.440	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	354.740	2,261,467.500	
ORACLE CORP	247,559	50.610	12,528,960.990	
PACCAR INC	26,537	58.360	1,548,699.320	
EXELON CORP	76,576	45.040	3,448,983.040	
PARKER HANNIFIN CORP	11,023	167.330	1,844,478.590	
PAYCHEX INC	26,670	69.020	1,840,763.400	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	56.950	371,655.700	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	235.960	1,381,309.840	
PPL CORPORATION	57,297	31.690	1,815,741.930	
PEPSICO INC	114,458	117.480	13,446,525.840	
PENTAIR PLC	11,775	42.530	500,790.750	
PFIZER INC	473,775	44.280	20,978,757.000	
CONOCOPHILLIPS	95,634	66.730	6,381,656.820	
PVH CORP	6,862	121.410	833,115.420	
PG&E CORP	42,378	39.920	1,691,729.760	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,308	159.820	2,286,704.560	
ALTRIA GROUP INC	153,240	63.420	9,718,480.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,072	134.230	5,110,404.560	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	90.960	349,741.200	
GARMIN LTD	7,795	66.110	515,327.450	
AETNA INC	26,607	209.360	5,570,441.520	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	46.600	457,658.600	
PPG INDUSTRIES INC	20,578	107.710	2,216,456.380	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	137.790	336,345.390	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,482	237.740	8,435,490.680	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,916	98.480	1,961,327.680	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	97.330	1,010,090.740	
PROCTER & GAMBLE CO	203,795	92.410	18,832,695.950	
PROGRESSIVE CORP	47,422	73.190	3,470,816.180	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	41,013	53.790	2,206,089.270	
PULTE GROUP INC	21,209	24.440	518,347.960	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	55,214	9.600	530,054.400	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	112.170	1,503,751.020	
QUALCOMM INC	114,098	56.720	6,471,638.560	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	79.500	809,866.500	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	124.920	318,546.000	

REGENERON PHARMACEUTICALS	6,415	356.660	2,287,973.900	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	148.760	690,543.920	
RESMED INC	12,271	106.940	1,312,260.740	
US BANCORP	124,839	53.150	6,635,192.850	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	58.060	424,825.020	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	28.350	890,813.700	
ROSS STORES INC	30,914	102.760	3,176,722.640	
ROLLINS INC	8,252	61.370	506,425.240	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,632	296.810	2,562,063.920	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	169.270	1,767,009.530	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,121	107.170	1,513,347.570	
RAYTHEON COMPANY	22,940	188.020	4,313,178.800	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	208.260	801,384.480	
ACCENTURE PLC-CL A	51,767	165.150	8,549,320.050	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	118,933	44.300	5,268,731.900	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	159.930	1,761,788.880	
ROCKWELL COLLINS INC	13,469	133.220	1,794,340.180	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,930	131.030	2,873,487.900	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,890	107.470	2,889,868.300	
BOOKING HOLDINGS INC	3,914	1,937.640	7,583,922.960	
SCHLUMBERGER LTD	111,419	50.400	5,615,517.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	96,501	47.640	4,597,307.640	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,874	117.620	1,984,719.880	
BUNGE LTD	10,334	63.270	653,832.180	
SEI INVESTMENTS CO	12,294	54.770	673,342.380	
ANTHEM INC	20,799	287.060	5,970,560.940	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	88.860	1,089,157.020	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	49.300	1,057,090.600	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,882	414.840	2,854,928.880	
CENTENE CORP	17,128	142.310	2,437,485.680	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	247.360	1,015,907.520	
IAC INTERACTIVE CORP	5,766	186.550	1,075,647.300	
SMITH (A.O.) CORP	15,481	45.760	708,410.560	
ACUITY BRANDS INC	3,087	126.940	391,863.780	
SNAP-ON INC	4,935	161.490	796,953.150	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,477	95.850	3,304,620.450	
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	171.180	1,083,569.400	
EDISON INTERNATIONAL	26,721	61.000	1,629,981.000	
SOUTHERN CO	81,919	46.810	3,834,628.390	
BB&T CORP	63,542	50.760	3,225,391.920	

SOUTHWEST AIRLINES	11,352	52.490	595,866.480	
AT&T INC	588,509	30.690	18,061,341.210	
CHEVRON CORP	154,746	119.510	18,493,694.460	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	125.740	1,644,301.980	
STATE STREET CORP	30,346	72.250	2,192,498.500	
STARBUCKS CORP	112,039	68.600	7,685,875.400	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	40.280	766,528.400	
STRYKER CORP	27,381	171.250	4,688,996.250	
NETFLIX INC	35,335	303.470	10,723,112.450	
STERICYCLE INC	6,853	47.660	326,613.980	
SUNTRUST BANKS INC	38,038	63.530	2,416,554.140	
SYMANTEC CORP	47,004	22.250	1,045,839.000	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	33.480	327,869.640	
SYNOPSIS INC	13,239	93.350	1,235,860.650	
SYSCO CORP	39,953	66.810	2,669,259.930	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,036	532.560	4,812,212.160	
TELEFLEX INC	3,905	265.880	1,038,261.400	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	80,553	23.450	1,888,967.850	
TEXAS INSTRUMENTS INC	79,219	96.100	7,612,945.900	
TEXTRON INC	19,076	56.880	1,085,042.880	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,661	243.450	7,951,320.450	
TIFFANY & CO	8,733	110.360	963,773.880	
TOLL BROTHERS INC	9,526	32.380	308,451.880	
TORCHMARK CORP	7,699	86.920	669,197.080	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	91.970	1,322,896.480	
DAVITA INC	10,878	69.700	758,196.600	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	97.130	900,977.880	
TRIMBLE INC	20,073	36.810	738,887.130	
TYSON FOODS INC	24,607	62.080	1,527,602.560	
UGI CORP	14,725	56.030	825,041.750	
MARATHON OIL CORP	64,347	17.840	1,147,950.480	
UNION PACIFIC CORP	62,785	150.250	9,433,446.250	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61,400	130.710	8,025,594.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,838	276.550	21,526,098.900	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	131.490	835,092.990	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	119.370	817,445.760	
VF CORP	27,791	84.160	2,338,890.560	
CBS CORP	27,376	57.550	1,575,488.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,994	180.550	3,790,466.700	
VULCAN MATERIALS CO	10,136	105.760	1,071,983.360	



WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,404	82.390	5,635,805.560	
WALMART INC	119,677	105.560	12,633,104.120	
WASTE MANAGEMENT INC	35,106	90.460	3,175,688.760	
WATERS CORP	5,963	199.440	1,189,260.720	
ALLERGAN PLC	26,766	165.520	4,430,308.320	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	112.880	999,552.400	
VAIL RESORTS INC	3,098	265.370	822,116.260	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	45.730	1,017,675.420	
WABTEC CORP	7,530	87.050	655,486.500	
WHIRLPOOL CORP	5,553	116.360	646,147.080	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	76.660	1,037,133.140	
WYNN RESORTS LTD	7,179	98.320	705,839.280	
NASDAQ INC	9,132	90.400	825,532.800	
CME GROUP INC	28,996	189.740	5,501,701.040	
WILLIAMS COS INC	99,653	25.330	2,524,210.490	
LKQ CORP	22,948	27.730	636,348.040	
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	44.610	888,185.100	
WEC ENERGY GROUP INC	27,657	70.000	1,935,990.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	52.500	1,133,002.500	
CARMAX INC	13,513	65.720	888,074.360	
XEROX CORP	17,455	28.430	496,245.650	
XILINX INC	21,093	85.640	1,806,404.520	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	90.320	632,510.960	
TJX COMPANIES INC	102,627	55.640	5,710,166.280	
ZIONS BANCORP NA	16,584	50.160	831,853.440	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.720	238,928.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.170	471,388.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	60.300	946,710.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	35.210	602,091.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	72.410	438,152.910	
SIGNATURE BANK	4,171	115.740	482,751.540	
CBRE GROUP INC	24,276	42.990	1,043,625.240	
LIBERTY GLOBAL PLC	19,835	25.120	498,255.200	
REGIONS FINANCIAL CORP	92,992	17.240	1,603,182.080	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	274.350	893,283.600	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	75.900	227,700.000	
T-MOBILE US INC	27,739	68.680	1,905,114.520	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,332	52.090	1,736,263.880	
MOSAIC CO/THE	31,433	36.630	1,151,390.790	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	35,913	47.710	1,713,409.230	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	85,706	48.160	4,127,600.960	
CELANESE CORP	11,880	102.760	1,220,788.800	
DISCOVERY INC-A	10,423	32.980	343,750.540	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	124.040	1,286,666.920	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	52.220	964,764.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,434	127.660	1,587,324.440	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	24.510	1,024,959.180	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,227	79.080	3,734,711.160	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	22.750	334,334.000	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	32.100	972,052.200	
LIVE NATION	13,682	56.400	771,664.800	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	490.760	886,803.320	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	92.350	571,738.850	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	357.460	1,362,637.520	
MASTERCARD INC	75,044	205.620	15,430,547.280	
QURATE RETAIL INC	35,733	24.520	876,173.160	
HANESBRANDS INC	27,619	16.560	457,370.640	
WESTERN UNION CO	35,222	18.820	662,878.040	
OWENS CORNING	7,333	47.370	347,364.210	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,182	65.230	859,861.860	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.250	605,368.500	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	89.240	818,777.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	15.600	282,344.400	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,519	107.210	1,127,741.990	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,653	15.700	465,552.100	
DELTA AIR LINES INC	13,898	56.650	787,321.700	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	50.730	322,338.420	
DISCOVER FINANCIAL	29,057	70.560	2,050,261.920	
TE CONNECTIVITY LTD	29,105	79.130	2,303,078.650	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,507	136.520	2,253,535.640	
WABCO HOLDING INC	4,076	111.170	453,128.920	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	137.560	1,084,385.480	
VMWARE INC	5,491	150.820	828,152.620	
MERCADOLIBRE INC	3,215	325.690	1,047,093.350	
ULTA BEAUTY INC	4,332	308.120	1,334,775.840	
INVESCO LTD	29,824	20.880	622,725.120	
MSCI INC	7,537	149.790	1,128,967.230	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,890	89.180	11,226,870.200	
VISA INC	144,332	143.930	20,773,704.760	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	89.610	1,209,018.120	
DISCOVERY INC-C	23,054	29.710	684,934.340	
MARATHON PETROLEUM CORP	56,609	67.180	3,802,992.620	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	43.490	505,527.760	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	164,092	17.530	2,876,532.760	
XYLEM INC	15,111	70.880	1,071,067.680	
ALKERMES PLC	12,053	37.670	454,036.510	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,218	96.060	2,614,561.080	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	223.650	778,078.350	
SPLUNK INC	12,240	98.540	1,206,129.600	
HCA HEALTHCARE INC	22,931	143.950	3,300,917.450	
VERISK ANALYTICS INC	11,859	123.380	1,463,163.420	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,474	145.570	796,850.180	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,443	199.820	1,487,260.260	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,676	92.900	1,270,500.400	
CIT GROUP INC	9,287	46.710	433,795.770	
NXP SEMICONDUCTOR NV	28,555	83.690	2,389,767.950	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	50.550	831,294.750	
LEAR CORP	5,132	138.010	708,267.320	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	108.900	940,896.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	49.940	848,980.000	
DOLLAR GENERAL CORP	22,291	116.100	2,587,985.100	
FORTINET INC	11,399	74.730	851,847.270	
AON PLC	19,838	164.540	3,264,144.520	
TESLA INC	10,430	350.510	3,655,819.300	
GENERAL MOTORS CO	103,588	35.700	3,698,091.600	
WORLDPAY INC	24,088	90.110	2,170,569.680	
XPO LOGISTICS INC	9,000	81.030	729,270.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	63.300	586,347.900	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	25.760	809,095.840	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	47.780	579,953.640	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	45.630	617,145.750	
APTIV PLC	22,571	75.620	1,706,819.020	
PHILLIPS 66	35,506	99.740	3,541,368.440	
FACEBOOK INC	194,641	144.960	28,215,159.360	
IQVIA HOLDINGS INC	13,426	124.170	1,667,106.420	
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,609	113.850	980,134.650	

SERVICENOW INC	14,659	177.590	2,603,291.810	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	183.090	1,282,728.540	
WORKDAY INC	12,376	139.930	1,731,773.680	
ABBVIE INC	123,298	88.790	10,947,629.420	
ZOETIS INC	39,459	95.270	3,759,258.930	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	48.750	802,912.500	
COTY INC	38,541	8.490	327,213.090	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	14.240	430,945.120	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.750	499,526.250	
CDW CORP	13,040	91.080	1,187,683.200	
SPRINT CORP	63,882	6.190	395,429.580	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	36.220	369,407.780	
ARCONIC INC	36,761	20.770	763,525.970	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	17,852	32.660	583,046.320	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.630	203,393.780	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	40.740	730,508.940	
DELL TECHNOLOGIES INC	16,584	98.050	1,626,061.200	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	20.740	319,603.400	
BAKER HUGHES A GE CO	31,904	25.510	813,871.040	
TECHNIPFMC LTD	32,556	25.650	835,061.400	
BROADCOM INC	33,381	238.990	7,977,725.190	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	41.570	415,076.450	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	15.700	206,659.100	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	93.600	850,543.200	
TWITTER INC	56,256	34.080	1,917,204.480	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	17,181	46.760	803,383.560	
EVERGY INC	21,000	58.350	1,225,350.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	22.050	172,805.850	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	19.390	250,518.800	
ALLEGION PLC	7,325	89.390	654,781.750	
PERRIGO CO PLC	10,553	64.070	676,130.710	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,612	71.160	1,609,069.920	
ARAMARK	21,772	35.600	775,083.200	
SABRE CORP	17,624	25.570	450,645.680	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	24.470	427,099.380	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	244.430	1,085,513.630	
IHS MARKIT LTD	30,253	52.910	1,600,686.230	
FNF GROUP	20,660	33.660	695,415.600	
SYNCHRONY FINANCIAL	60,568	27.620	1,672,888.160	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	40,320	38.060	1,534,579.200	
CDK GLOBAL INC	8,309	50.770	421,847.930	

KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	59.190	846,417.000	
QORVO INC	10,887	68.150	741,949.050	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	23.260	374,230.140	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	82.170	642,405.060	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	25.340	372,751.400	
GODADDY INC	14,641	64.460	943,758.860	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	26.460	710,186.400	
TRANSUNION	13,841	66.440	919,596.040	
SQUARE INC	23,565	73.270	1,726,607.550	
DOWDUPONT INC	188,426	58.680	11,056,837.680	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	47.950	819,945.000	
WESTROCK CO	24,042	45.810	1,101,364.020	
KRAFT HEINZ CO	50,303	53.990	2,715,858.970	
FORTIVE CORP	23,630	75.220	1,777,448.600	
WASTE CONNECTIONS INC	23,491	76.960	1,807,867.360	
ALPHABET INC-CL A	24,209	1,077.020	26,073,577.180	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,608	15.720	1,974,557.760	
PAYPAL HOLDINGS INC	91,645	86.760	7,951,120.200	
FIRST DATA CORP	44,487	18.650	829,682.550	
DXC TECHNOLOGY CO	23,734	62.000	1,471,508.000	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	30.250	246,053.500	
ALPHABET INC-CL C	25,453	1,066.150	27,136,715.950	
L3 TECHNOLOGIES INC	6,752	195.380	1,319,205.760	
CHEMOURS CO	12,723	32.090	408,281.070	
LINDE PLC	23,235	161.520	3,752,917.200	
ATHENE HOLDING LTD	11,784	47.490	559,622.160	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,415	321.110	4,307,690.650	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	24.080	722,400.000	
アメリカ・ドル 小計	24,756,189		1,943,429,215.910 (221,434,324,862)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.782	201,592.710	
ASHTED GROUP	42,154	19.000	800,926.000	
SEVERN TRENT PLC	25,530	19.805	505,621.650	
BHP BILLITON PLC	173,514	15.856	2,751,237.980	
BARCLAYS PLC	1,386,487	1.768	2,451,309.010	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103,764	5.440	564,476.160	
BT GROUP PLC	696,796	2.541	1,770,558.630	
BUNZL PLC	26,515	22.320	591,814.800	
EASYJET PLC	13,628	12.540	170,895.120	
AVIVA PLC	303,368	4.337	1,315,707.010	
CRODA INTERNATIONAL	10,645	48.020	511,172.900	
DIAGEO PLC	198,910	27.465	5,463,063.150	
SCHRODERS PLC	10,932	26.070	284,997.240	

DCC PLC	9,753	63.600	620,290.800	
NATIONAL GRID PLC	273,118	8.557	2,337,070.720	
KINGFISHER PLC	165,680	2.551	422,649.680	
BAE SYSTEMS PLC	268,920	5.292	1,423,124.640	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	186,589	33.145	6,184,492.400	
NEXT PLC	12,064	54.240	654,351.360	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,173	27.500	2,149,757.500	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	29.470	442,550.990	
ANGLO AMERICAN PLC	88,044	16.878	1,486,006.630	
COMPASS GROUP PLC	129,886	15.375	1,996,997.250	
HSBC HOLDINGS PLC	1,621,805	6.338	10,279,000.090	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	491,194	2.616	1,284,963.500	
CENTRICA PLC	471,340	1.543	727,277.620	
UNILEVER PLC	99,387	41.465	4,121,081.950	
MEGGITT PLC	62,181	5.072	315,382.030	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.513	391,228.860	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.720	420,639.640	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.458	441,355.710	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	26.380	797,731.200	
PEARSON PLC	65,009	9.218	599,252.960	
PERSIMMON PLC	23,150	23.860	552,359.000	
PRUDENTIAL PLC	208,962	16.040	3,351,750.480	
RIO TINTO PLC	96,815	38.495	3,726,893.420	
VODAFONE GROUP PLC	2,120,291	1.439	3,051,098.740	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,007	62.550	3,315,587.850	
RELX PLC	161,945	15.585	2,523,912.820	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	138,993	8.144	1,131,958.990	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	389,955	2.519	982,296.640	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.625	434,392.500	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	10.705	217,921.680	
SSE PLC	84,479	11.525	973,620.470	
BP PLC	1,619,051	5.239	8,482,208.180	
SHIRE PLC	72,222	46.125	3,331,239.750	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.514	470,184.290	
SMITHS GROUP PLC	31,720	13.550	429,806.000	
STANDARD CHARTERED PLC	234,243	5.693	1,333,545.390	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,810,675	0.599	3,480,594.320	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.680	425,076.960	
TESCO PLC	804,334	2.187	1,759,078.450	
3I GROUP PLC	89,718	8.652	776,240.130	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.950	922,862.250	

GLAXOSMITHKLINE PLC	403,297	15.704	6,333,376.080	
WEIR GROUP	18,336	15.505	284,299.680	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	42.130	1,106,586.580	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.004	127,897.200	
WPP PLC	107,494	8.570	921,223.580	
FERGUSON PLC	17,278	51.800	895,000.400	
ASTRAZENECA PLC	103,035	61.720	6,359,320.200	
WHITBREAD PLC	15,639	45.930	718,299.270	
CARNIVAL PLC	13,153	43.710	574,917.630	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.127	376,146.830	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.650	325,770.200	
INTERTEK GROUP PLC	14,335	46.090	660,700.150	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.735	530,152.350	
INVESTEC PLC	50,655	4.971	251,806.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,922	40.590	646,273.980	
ITV PLC	247,210	1.506	372,298.260	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	3.220	441,832.300	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	61.960	433,596.080	
G4S PLC	122,250	1.831	223,839.750	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.540	326,442.220	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	36.400	390,426.400	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	370,576	24.180	8,960,527.680	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	305,905	24.625	7,532,910.620	
TUI AG-DI	45,043	12.835	578,126.900	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.701	579,945.210	
EXPERIAN PLC	71,068	18.150	1,289,884.200	
MONDI PLC	28,318	17.505	495,706.590	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	19.160	407,916.400	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.610	134,651.790	
INFORMA PLC	102,475	7.106	728,187.350	
GLENCORE PLC	929,853	3.039	2,825,823.260	
GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.380	415,798.840	
NMC HEALTH PLC	8,149	35.300	287,659.700	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.252	366,480.880	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	3.581	109,635.890	
COCA-COLA HBC AG	13,406	23.720	317,990.320	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.565	185,296.000	
ROYAL MAIL PLC	55,060	3.458	190,397.480	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.302	165,222.170	

	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	5,380,436	0.001	5,380.430	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	12.845	415,432.990	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.470	341,275.560	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.706	712,459.720	
イギリス・債券	小計	29,778,613		145,498,121.320 (21,444,968,102)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	78,428	26.420	2,072,067.760	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	24.680	2,543,545.480	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.427	833,294.210	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	459.600	808,896.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	23.620	1,167,087.820	
	NICE LTD	4,035	418.200	1,687,437.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	66.770	697,345.880	
	AZRIELI GROUP	4,428	189.900	840,877.200	
イスラエル・シュケル	小計	439,797		10,650,551.350 (329,847,575)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	56.680	629,998.200	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	239,374	27.130	6,494,216.620	
	AMCOR LTD	110,142	13.650	1,503,438.300	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	270,531	27.700	7,493,708.700	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.920	303,244.480	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.250	485,031.250	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.040	829,673.760	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.550	411,597.700	
	AMP LTD	200,498	2.670	535,329.660	
	ASX LTD	15,573	61.180	952,756.140	
	BHP BILLITON LTD	255,718	33.410	8,543,538.380	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	27.110	567,846.060	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.260	72,313.320	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	20.430	777,157.200	
	CSL LIMITED	35,919	190.580	6,845,443.020	
	REA GROUP LTD	4,119	80.500	331,579.500	
	TRANSURBAN GROUP	223,354	11.450	2,557,403.300	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.180	494,758.180	
	COCHLEAR LTD	6,524	176.130	1,149,072.120	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	7.060	859,350.260	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	138,412	70.950	9,820,331.400		
BORAL LIMITED	86,101	5.550	477,860.550		



	RIO TINTO LIMITED	36,396	81.230	2,956,447.080	
	APA GROUP	116,193	8.880	1,031,793.840	
	ARISTOCRAT LEISU	43,933	27.130	1,191,902.290	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	167,355	7.220	1,208,303.100	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.480	214,818.120	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	45.620	149,405.500	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	16.900	481,464.100	
	ORICA LTD	25,308	18.470	467,438.760	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	46.580	405,665.220	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	13.730	507,199.930	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.570	559,304.100	
	MACQUARIE GROUP LTD	28,250	123.640	3,492,830.000	
	SUNCORP GROUP LTD	124,185	14.080	1,748,524.800	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	217,098	24.900	5,405,740.200	
	NEWCREST MINING LTD	59,818	20.880	1,248,999.840	
	OIL SEARCH LTD	138,806	7.700	1,068,806.200	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	4.240	578,446.240	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	129,436	11.490	1,487,219.640	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	9.840	449,756.880	
	SANTOS LTD	133,862	6.420	859,394.040	
	SONIC HEALTHCARE	43,041	22.490	967,992.090	
	TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.630	584,991.240	
	WESFARMERS LTD	96,821	47.420	4,591,251.820	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.490	459,686.370	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	33.770	2,671,713.550	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	29.420	2,916,757.640	
	SEEK LTD	25,899	17.810	461,261.190	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	49.120	225,018.720	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.710	282,262.860	
	AGL ENERGY LTD	46,315	17.900	829,038.500	
	BRAMBLES LTD	115,255	10.560	1,217,092.800	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.770	386,773.970	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.270	594,315.680	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	15.340	779,103.260	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.080	310,017.760	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.820	499,636.320	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.540	1,299,381.780	
オーストラリア・ドル	小計	5,801,843		96,725,403.530 (7,959,533,457)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	45.250	917,715.250	

ALIMENTATION COUCHE TARD INC	36,030	66.660	2,401,759.800	
BARRICK GOLD CORP	96,442	17.090	1,648,193.780	
ATCO LTD	7,193	39.520	284,267.360	
BANK OF MONTREAL	51,533	98.870	5,095,067.710	
BANK OF NOVA SCOTIA	96,922	70.790	6,861,108.380	
NATIONAL BANK OF CANADA	26,741	60.450	1,616,493.450	
BCE INC	11,568	54.100	625,828.800	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	70,084	57.180	4,007,403.120	
BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	35.950	928,193.050	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.650	401,779.750	
SAPUTO INC	18,601	38.840	722,462.840	
BLACKBERRY LTD	39,652	12.280	486,926.560	
CGI GROUP INC	19,367	81.680	1,581,896.560	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	52.770	598,411.800	
CAE INC	23,000	24.380	560,740.000	
CAMECO CORP	32,627	15.770	514,527.790	
ROGERS COMM-CL B	30,822	67.540	2,081,717.880	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	35,771	115.230	4,121,892.330	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	101,994	37.160	3,790,097.040	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	162.640	790,755.680	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	31.430	286,610.170	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,464	113.170	6,616,370.880	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.620	224,001.540	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	22,472	41.780	938,880.160	
OPEN TEXT CORP	19,756	43.580	860,966.480	
EMPIRE CO LTD	15,093	24.310	366,910.830	
KINROSS GOLD CORP	99,741	3.420	341,114.220	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	27.700	274,008.400	
FORTIS INC	33,302	45.600	1,518,571.200	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	11.970	661,893.120	
TELUS CORP	15,945	45.880	731,556.600	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	30.540	587,833.920	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	40.880	880,636.960	
ENBRIDGE INC	135,898	43.490	5,910,204.020	
IGM FINANCIAL INC	8,426	34.210	288,253.460	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.370	208,548.150	
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,105	22.330	3,642,134.650	
LINAMAR CORP	3,827	48.210	184,499.670	
LOBLAW CO LTD	15,354	58.330	895,598.820	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	13,994	48.570	679,688.580	

MAGNA INTERNATIONAL INC	28,590	65.360	1,868,642.400	
SUN LIFE FINANCIAL INC	51,387	48.450	2,489,700.150	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,419	626.210	1,514,801.990	
METRO INC	19,226	43.630	838,830.380	
HUSKY ENERGY INC	28,749	18.260	524,956.740	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	5.640	225,554.880	
EMERA INC	6,509	43.080	280,407.720	
METHANEX CORP	5,281	85.130	449,571.530	
ONEX CORP	6,646	86.280	573,416.880	
GOLDCORP INC	66,602	12.160	809,880.320	
POWER CORP OF CANADA	25,052	26.890	673,648.280	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	28.450	497,419.800	
ROYAL BANK OF CANADA	115,983	95.950	11,128,568.850	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	46.570	611,650.380	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,916	275.650	3,284,645.400	
SHAW COMM INC-B	35,748	24.640	880,830.720	
SUNCOR ENERGY INC	130,238	44.410	5,783,869.580	
LUNDIN MINING CORP	35,268	5.340	188,331.120	
ENCANA CORP	87,517	11.670	1,021,323.390	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	27.520	1,128,760.320	
THOMSON REUTERS CORP	17,373	63.500	1,103,185.500	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	148,499	73.240	10,876,066.760	
TRANSCANADA CORP	74,445	51.320	3,820,517.400	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	65.370	372,347.520	
WESTON (GEORGE) LTD	9,372	93.770	878,812.440	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	105.040	1,132,856.400	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	21.540	731,132.220	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	893.660	1,545,138.140	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	85.690	1,258,529.030	
CI FINANCIAL CORP	20,695	20.120	416,383.400	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	19.750	311,635.250	
KEYERA CORP	13,728	29.530	405,387.840	
ALTAGAS LTD	23,944	15.750	377,118.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	45.320	1,984,290.880	
DOLLARAMA INC	28,295	36.980	1,046,349.100	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	11.820	952,041.900	
VERMILION ENERGY INC	12,923	31.620	408,625.260	
ARC RESOURCES LTD	22,997	10.490	241,238.530	
INTER PIPELINE LTD	41,866	23.340	977,152.440	
NUTRIEN LTD	50,076	74.080	3,709,630.080	
WSP GLOBAL INC	8,400	67.470	566,748.000	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	19.350	289,495.350	

	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	12.450	214,525.950	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	75.040	1,550,626.560	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	9.360	468,000.000	
	SHOPIFY INC	6,500	186.230	1,210,495.000	
	CANOPY GROWTH CORP	15,000	51.490	772,350.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	19.300	527,662.000	
カナダ・ドル 小計		3,332,164		139,058,672.540 (12,006,325,787)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.470	433,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.630	214,082.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.650	327,805.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.250	173,035.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	23.740	3,200,152.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.450	245,050.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	34.300	203,879.200	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.880	206,424.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.190	495,391.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.130	602,258.950	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.950	395,580.000	
	KEPPEL CORP LTD	168,400	6.200	1,044,080.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.180	387,822.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	267,053	11.460	3,060,427.380	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.100	1,834,958.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.520	452,200.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	110,800	24.660	2,732,328.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.280	254,340.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	14.700	308,700.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.150	448,245.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.300	245,440.000		
シンガポール・ドル 小計		3,668,174		17,265,947.730 (1,426,512,602)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	211,414	12.985	2,745,210.790	
	NESTLE SA-REGISTERED	251,407	85.400	21,470,157.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	42,886	69.100	2,963,422.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	56,955	251.350	14,315,639.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	210.400	758,912.800	
	SIKA INHABER	11,291	129.700	1,464,442.700	
	SGS SA-REG	405	2,312.000	936,360.000	

NOVARTIS AG-REG SHS	175,788	89.720	15,771,699.360	
BALOISE HOLDING AG -R	4,127	149.000	614,923.000	
BARRY CALLEBAUT AG	144	1,988.000	286,272.000	
CLARIANT AG-REG	19,496	21.900	426,962.400	
SWISSCOM AG-REG	2,320	462.800	1,073,696.000	
ABB LTD	150,930	20.270	3,059,351.100	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	50.060	617,790.460	
GEBERIT AG	3,243	385.500	1,250,176.500	
LONZA GROUP AG-REG	6,228	327.300	2,038,424.400	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	7,095.000	532,125.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	81,400.000	732,600.000	
GIVAUDAN-REG	771	2,406.000	1,855,026.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,237	314.400	3,847,312.800	
LAFARGEHOLCIM LTD	40,615	46.880	1,904,031.200	
TEMENOS GROUP	4,521	136.400	616,664.400	
SONOVA HOLDING AG	4,142	163.400	676,802.800	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,105	137.850	703,724.250	
STRAUMANN HOLDING AG	782	689.000	538,798.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	322.400	745,066.400	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	63.050	289,525.600	
SCHINDLER NAMEN	1,663	205.200	341,247.600	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,614	391.000	1,022,074.000	
VIFOR PHARMA AG	3,050	139.000	423,950.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	558.500	308,850.500	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	83.000	497,170.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	73.450	220,350.000	
DUFREY GROUP	2,390	106.300	254,057.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	708.000	1,065,540.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	45.480	811,772.520	
SWISS RE LTD	25,796	92.400	2,383,550.400	
UBS GROUP AG	307,020	14.120	4,335,122.400	
スイス・フラン 小計	1,399,172		93,898,802.030 (10,635,917,307)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	57,191	217.900	12,461,918.900	
ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	203.050	6,274,041.950	
ERICSSON LM-B SHS	251,529	81.840	20,585,133.360	
LUNDBERGS B	7,382	284.600	2,100,917.200	
SKF AB-B SHS	24,866	142.150	3,534,701.900	
SANDVIK AB	85,032	138.650	11,789,686.800	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	95.060	12,256,561.100	
SKANSKA AB-B SHS	32,547	147.200	4,790,918.400	
SWEDBANK AB	74,223	208.100	15,445,806.300	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	133,024	100.650	13,388,865.600	
VOLVO AB-B SHS	129,013	135.200	17,442,557.600	

	SWEDISH MATCH AB	16,488	478.400	7,887,859.200	
	TELE2 AB-B SHS	44,876	102.800	4,613,252.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	189.700	2,163,149.100	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	193.450	3,712,498.950	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	155.300	3,742,419.400	
	INVESTOR AB-B SHS	37,657	393.000	14,799,201.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	159.040	10,567,889.920	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	177.250	13,687,776.750	
	TELIA CO AB	216,239	42.090	9,101,499.510	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	264.000	4,432,560.000	
	BOLIDEN AB	21,855	201.000	4,392,855.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	218.800	5,107,448.400	
	KINNEVIK AB-B	18,310	240.400	4,401,724.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	533.500	2,844,622.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	322.200	1,907,424.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	69.040	2,326,095.680	
	HEXAGON AB	22,037	458.200	10,097,353.400	
	EPIROC AB-A	48,377	75.460	3,650,528.420	
	EPIROC AB-B	30,899	72.190	2,230,598.810	
	ESSITY AB-B	46,071	212.600	9,794,694.600	
	NORDEA BANK ABP	247,034	80.700	19,935,643.800	
スウェーデン・クローナ 小計		1,987,924		261,468,203.850 (3,278,811,277)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	9,644	731.400	7,053,621.600	
	A P MOLLER A/S	604	8,662.000	5,231,848.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,100.000	2,211,300.000	
	DANSKE BANK A/S	61,114	144.150	8,809,583.100	
	GENMAB A/S	4,613	992.400	4,577,941.200	
	NOVOZYMES-B SHS	19,111	331.300	6,331,474.300	
	NOVO NORDISK A/S-B	148,352	295.500	43,838,016.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	484.500	7,658,976.000	
	COLOPLAST-B	9,195	633.400	5,824,113.000	
	DSV A/S	14,452	525.400	7,593,080.800	
	WILLIAM DEMANT	6,537	212.000	1,385,844.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	285.200	1,380,368.000	
	TRYG A/S	11,107	167.600	1,861,533.200	
	PANDORA A/S	8,251	349.400	2,882,899.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	643.000	4,956,244.000	
	ISS A/S	16,240	224.300	3,642,632.000	
ORSTED A/S	15,020	455.300	6,838,606.000		
デンマーク・クローネ 小計		352,869		122,078,080.600 (2,110,730,014)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	7.200	511,992.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.320	368,294.080	
	A2 MILK CO LTD	55,091	10.420	574,048.220	

	FISHER & PAYKEL	42,678	13.900	593,224.200	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	6.100	391,034.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.065	648,867.490	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.240	292,160.520	
ニュージーランド・ドル 小計		512,673		3,379,620.910 (259,352,109)	
ノルウェー・ク ローネ	MARINE HARVEST	33,000	203.500	6,715,500.000	
	DNB ASA	79,783	156.700	12,501,996.100	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	42.380	3,893,832.020	
	TELENOR ASA	62,076	158.450	9,835,942.200	
	ORKLA ASA	61,421	72.400	4,446,880.400	
	EQUINOR ASA	96,460	208.200	20,082,972.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	380.000	6,080,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	250.200	2,139,710.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	137.400	2,292,244.200	
	SCHIBSTED ASA	7,445	284.000	2,114,380.000	
ノルウェー・クローネ 小計		473,299		70,103,457.320 (946,396,673)	
ユーロ	CRH PLC	71,394	25.800	1,841,965.200	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	75.200	469,699.200	
	KERRY GROUP PLC-A	13,865	94.100	1,304,696.500	
	UMICORE	15,320	42.610	652,785.200	
	AIR LIQUIDE	35,105	106.650	3,743,948.250	
	AIRBUS SE	47,562	94.680	4,503,170.160	
	AXA	158,512	22.305	3,535,610.160	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	18.890	753,956.570	
	ADIDAS AG	15,468	203.900	3,153,925.200	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.435	1,273,643.350	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,400.000	219,800.000	
	DANONE	50,307	65.610	3,300,642.270	
	SAFRAN SA	27,473	112.450	3,089,338.850	
	INTESA SANPAOLO	1,276,073	2.005	2,558,526.360	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,431	73.360	2,012,338.160	
	ACCOR SA	16,000	39.800	636,800.000	
	BOUYGUES	16,412	33.060	542,580.720	
	BNP PARIBAS	89,099	46.365	4,131,075.130	
	THALES SA	8,128	113.600	923,340.800	
	CAPGEMINI SA	13,759	109.600	1,507,986.400	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	38.040	162,202.560	
	INGENICO GROUP	4,334	66.020	286,130.680	
	UNICREDIT SPA	170,144	11.230	1,910,717.120	
	NATIXIS	70,166	5.282	370,616.810	
KONINKLIJKE DSM NV	15,111	79.100	1,195,280.100		
COMMERZBANK AG	83,118	8.714	724,290.250		
EIFFAGE	5,949	89.020	529,579.980		

FRESENIUS SE & CO KGAA	34,640	52.820	1,829,684.800	
UNITED INTERNET	9,882	36.490	360,594.180	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	40.820	226,387.720	
PUBLICIS GROUPE	18,222	52.340	953,739.480	
FAURECIA	6,117	40.980	250,674.660	
IBERDROLA SA	483,541	6.570	3,176,864.370	
ENI SPA	208,385	15.456	3,220,798.560	
IMERYS SA	2,256	52.150	117,650.400	
JERONIMO MARTINS	19,517	10.760	210,002.920	
KBC GROUPE	20,803	61.840	1,286,457.520	
HANNOVER RUECK SE	4,868	125.300	609,960.400	
WARTSILA OYJ	34,935	15.515	542,016.520	
L'OREAL	20,735	205.600	4,263,116.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,721	266.000	6,043,786.000	
GEA GROUP AG	11,838	26.450	313,115.100	
BOLLORE	71,347	3.784	269,977.040	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.862	333,380.240	
MICHELIN(CGDE)-B	15,018	89.660	1,346,513.880	
CONTINENTAL AG	9,528	138.050	1,315,340.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,561	28.570	2,330,197.770	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.240	176,574.240	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	27.350	257,062.650	
AXEL SPRINGER SE	3,067	58.100	178,192.700	
OMV AG	12,817	48.830	625,854.110	
PERNOD-RICARD	17,210	142.400	2,450,704.000	
PEUGEOT SA	50,087	20.680	1,035,799.160	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	56.560	749,363.440	
RENAULT SA	14,378	64.940	933,707.320	
REPSOL SA	113,583	15.850	1,800,290.550	
REMY COINTREAU	1,860	107.900	200,694.000	
MERCK KGAA	11,193	94.860	1,061,767.980	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	43,206	31.890	1,377,839.340	
RWE AG	39,183	18.565	727,432.390	
SEB SA	1,405	125.700	176,608.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	55.440	643,214.880	
SOCIETE GENERALE-A	63,145	33.690	2,127,355.050	
VINCI S.A.	40,569	78.840	3,198,459.960	
SODEXO	8,639	93.700	809,474.300	
SOLVAY SA	7,479	101.950	762,484.050	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,923	63.880	2,869,681.240	
VIVENDI SA	86,200	21.410	1,845,542.000	
SAP SE	79,870	95.170	7,601,227.900	
TELEFONICA S.A	381,954	7.469	2,852,814.420	
TOTAL SA	194,657	50.490	9,828,231.930	
VALEO	17,731	26.030	461,537.930	



E.ON SE	181,272	8.741	1,584,498.550	
VOEST-ALPINE AG	9,875	31.130	307,408.750	
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	87.000	683,646.000	
SIEMENS AG-REG	62,131	102.340	6,358,486.540	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	26.790	1,103,667.630	
ING GROEP NV-CVA	317,283	11.314	3,589,739.860	
PUMA AG	600	447.000	268,200.000	
BAYER AG	76,137	71.000	5,405,727.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	12.880	544,862.640	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,350	96.960	1,488,336.000	
DAIMLER AG	74,460	50.760	3,779,589.600	
BASF SE	74,943	68.850	5,159,825.550	
BEIERSDORF AG	8,371	91.780	768,290.380	
HOCHTIEF AG	1,707	133.700	228,225.900	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	60.100	661,640.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	70.820	1,309,745.080	
ORANGE	160,420	14.630	2,346,944.600	
SAMPO OYJ-A SHS	36,209	41.360	1,497,604.240	
RANDSTAD NV	7,794	43.720	340,753.680	
ALLIANZ SE	35,615	192.000	6,838,080.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.110	589,752.410	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	102,303	22.600	2,312,047.800	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	16.970	298,705.940	
HERMES INTL	2,703	495.200	1,338,525.600	
ENDESA S.A.	21,037	19.850	417,584.450	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	20.240	323,091.120	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	36.680	921,291.560	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,314	192.750	2,373,523.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	22.260	1,295,287.140	
SOCIETE BIC SA	2,478	89.050	220,665.900	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	111.800	1,220,073.400	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,033	34.740	661,206.420	
HEINEKEN NV	20,425	79.500	1,623,787.500	
AKZO NOBEL	21,135	74.460	1,573,712.100	
ASML HOLDING NV	33,271	152.220	5,064,511.620	
AEGON NV	150,349	5.562	836,241.130	
BANKINTER S.A.	57,960	7.548	437,482.080	
VOLKSWAGEN AG	2,329	143.200	333,512.800	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,382	146.060	2,246,694.920	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	546,038	4.911	2,681,592.610	
KERING	6,164	393.200	2,423,684.800	
CNP ASSURANCES	13,987	20.320	284,215.840	
FORTUM OYJ	37,452	19.320	723,572.640	

AGEAS	12,993	45.190	587,153.670	
UCB SA	11,267	75.880	854,939.960	
THYSSENKRUPP AG	37,894	17.330	656,703.020	
UNILEVER NV-CVA	125,123	48.545	6,074,096.030	
CARREFOUR SA	51,094	17.575	897,977.050	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	23.160	671,871.600	
ATOS SE	7,050	77.360	545,388.000	
NOKIA OYJ	464,181	5.172	2,400,744.130	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,543	33.605	2,605,832.510	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,097	52.140	1,360,697.580	
SANOFI	91,601	80.200	7,346,400.200	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	12.995	661,172.600	
ELISA OYJ	9,517	37.370	355,650.290	
BANCO SANTANDER SA	1,317,818	4.239	5,586,230.500	
METSO OYJ	8,585	26.810	230,163.850	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.280	667,010.880	
QIAGEN N.V.	17,387	31.770	552,384.990	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	39.060	122,999.940	
DEUTSCHE BANK AG-REG	163,922	8.958	1,468,413.270	
BMW VORZUG	4,116	64.750	266,511.000	
K & S	14,982	17.280	258,888.960	
ENEL SPA	674,493	4.483	3,023,752.110	
COLRUYT NV	4,673	55.300	258,416.900	
VOPAK (KON.)	5,364	40.550	217,510.200	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,620	14.695	3,873,895.900	
SARTORIUS AG	2,712	132.700	359,882.400	
LEONARDO SPA	26,269	8.862	232,795.870	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	72.620	429,256.820	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	18.190	1,802,046.920	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.385	694,104.160	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	437.600	347,454.400	
TELEPERFORMANCE	4,436	150.900	669,392.400	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,641	111.150	1,738,497.150	
EURAZEO	4,725	66.000	311,850.000	
BANCO SABADELL	563,371	1.186	668,158.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	81.500	473,841.000	
FRAPORT AG	3,149	71.020	223,641.980	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	76.800	751,948.800	
INDITEX	90,509	26.420	2,391,247.780	
JC DECAUX SA	6,058	29.120	176,408.960	
ANDRITZ AG	6,265	43.080	269,896.200	
MAPFRE SA	84,474	2.548	215,239.750	
ESSILORLUXOTTICA	17,293	120.200	2,078,618.600	
SNAM SPA	158,419	3.878	614,348.880	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	11.358	972,074.430	
ENAGAS	18,095	24.600	445,137.000	
WENDEL	2,220	111.200	246,864.000	

WIRECARD AG	9,891	157.400	1,556,843.400	
TENARIS SA	36,959	12.945	478,434.250	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.516	408,756.100	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.443	220,435.020	
ATLANTIA SPA	34,969	18.470	645,877.430	
ILIAD SA	2,102	100.150	210,515.300	
PROXIMUS	14,283	22.850	326,366.550	
SES FDR	24,585	18.695	459,616.570	
TERNA SPA	112,686	4.808	541,794.280	
BIOMERIEUX	3,248	68.400	222,163.200	
GRIFOLS SA	23,518	26.100	613,819.800	
FERROVIAL SA	37,657	17.795	670,106.310	
LANXESS AG	6,856	56.020	384,073.120	
NESTE OYJ	10,840	71.060	770,290.400	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	24.950	240,542.950	
RECORDATI SPA	6,859	30.230	207,347.570	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	7.435	264,559.600	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	182.600	723,096.000	
KONE OYJ	30,060	43.410	1,304,904.600	
ENGIE	149,944	12.575	1,885,545.800	
ALSTOM	12,046	38.020	457,988.920	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	43.260	157,206.840	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.380	230,521.960	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	15.630	675,184.740	
IPSEN SA	2,487	127.500	317,092.500	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	41.330	1,104,089.620	
ARKEMA SA	5,230	94.960	496,640.800	
LEGRAND SA	23,308	55.180	1,286,135.440	
ADP	2,313	185.100	428,136.300	
ORION OYJ	8,051	30.000	241,530.000	
RTL GROUP SA	3,446	52.150	179,708.900	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.775	560,282.770	
SYMRISE AG	9,628	72.020	693,408.560	
SCOR SE	13,875	43.570	604,533.750	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	26.860	467,283.420	
REXEL SA	23,245	10.565	245,583.420	
PRYSMIAN SPA	29,418	17.820	524,228.760	
CAIXABANK	297,224	3.670	1,090,812.080	
BUREAU VERITAS SA	21,480	19.630	421,652.400	
GETLINK	37,646	11.535	434,246.610	
SUEZ SA	25,406	13.555	344,378.330	
AMADEUS IT GROUP SA	36,055	69.860	2,518,802.300	
BRENTTAG AG	12,353	43.200	533,649.600	

	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.380	330,232.860	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	26.720	309,284.000	
	EDENRED	18,306	34.300	627,895.800	
	BANKIA SA	100,675	2.904	292,360.200	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.434	211,331.790	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	62.220	324,663.960	
	OSRAM LICHT AG	7,017	34.420	241,525.140	
	KION GROUP AG	4,686	50.520	236,736.720	
	VONOVIA SE	40,775	41.960	1,710,919.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.345	465,006.010	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	38.860	388,600.000	
	FERROVIAL SA-RTS	37,657	0.412	15,514.680	
	FERRARI NV	9,503	97.920	930,533.760	
	METRO AG	10,774	13.820	148,896.680	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	8.796	691,761.420	
	AIB GROUP PLC	52,322	3.942	206,253.320	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	37.050	361,941.450	
	MONCLER SPA	14,353	30.320	435,182.960	
	NN GROUP NV	21,965	38.550	846,750.750	
	ZALANDO SE	6,674	31.400	209,563.600	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	14.290	1,285,771.330	
	AENA SME SA	5,256	139.400	732,686.400	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	23.080	790,513.080	
	EXOR NV	7,726	51.160	395,262.160	
	COVESTRO AG	14,459	57.500	831,392.500	
	LINDE PLC	21,335	143.500	3,061,572.500	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,448	65.680	3,970,224.640	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.870	274,903.050	
	AMUNDI SA	3,894	51.960	202,332.240	
	SCHAEFFLER AG	12,644	8.342	105,476.240	
	PIRELLI & C SPA	34,086	6.190	210,992.340	
	UNIPER SE	13,897	26.160	363,545.520	
	DELIVERY HERO SE	7,238	36.860	266,792.680	
ユーロ	小計	15,861,356		298,834,969.850 (38,537,757,712)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	74.950	1,244,170.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	14.680	2,407,520.000	
	BANK OF EAST ASIA	153,660	25.650	3,941,379.000	
	CLP HOLDINGS LTD	149,500	85.700	12,812,150.000	
	PCCW LTD	331,000	4.310	1,426,610.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	1.650	878,460.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	57.450	2,815,050.000	

HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	105,040	221.400	23,255,856.000	
MTR CORP	118,500	38.300	4,538,550.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	19.740	1,243,620.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	177.900	9,962,400.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	37.350	3,444,715.800	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	52.300	5,046,950.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	20.600	1,972,450.000	
HONG KONG & CHINA GAS	837,050	14.820	12,405,081.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	37.450	1,872,500.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	42.900	7,979,400.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	25.150	829,950.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	29.050	7,611,100.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.540	2,097,900.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	22.900	1,156,450.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	10.240	4,518,563.840	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	11.060	1,150,240.000	
SINO LAND CO	255,400	12.400	3,166,960.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	106.000	14,310,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	83.250	2,497,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	41.000	4,653,500.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	43.000	2,408,000.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	25.450	1,119,800.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	6.490	1,012,440.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	16.160	2,010,304.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	11.680	756,864.000	
AIA GROUP LTD	996,027	62.650	62,401,091.550	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.760	3,034,320.000	
SANDS CHINA LTD	232,800	31.700	7,379,760.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	28.050	2,922,810.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	47.300	4,528,975.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.440	1,711,200.000	
WH GROUP LTD	701,500	6.100	4,279,150.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	224,832	79.000	17,761,728.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	53.250	11,865,804.000	
香港・ドル 小計	8,191,035		262,431,272.190 (3,818,375,010)	
合計	96,555,108		324,188,852,487 (324,188,852,487)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

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	80,596.000	811,601.720	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,270,918.550	
		GPT GROUP	144,955.000	765,362.400	
		LENDLEASE GROUP	60,871.000	867,411.750	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	650,722.600	
		SCENTRE GROUP	476,956.000	1,922,132.680	
		STOCKLAND	194,018.000	710,105.880	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	727,491.670	
	オーストラリア・ドル	小計	1,645,241.000	7,725,747.250 (635,751,741)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	512,055.300	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	348,647.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	423,870.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	336,175.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,620,747.300 (133,906,141)	
	投資信託受益証券	合計		2,443,447	769,657,882 (769,657,882)
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,741.000	591,957.280	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,664.000	1,202,781.440	
		AMERICAN TOWER CORP	35,796.000	5,732,371.440	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	110,918.000	1,115,835.080	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,353.000	2,072,263.090	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,674.000	1,699,131.240	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	368,328.240	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	746,057.480	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,818.000	3,638,531.660	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,035.000	1,884,411.700	
		DUKE REALTY TRUST	33,801.000	966,032.580	
		EQUINIX INC	6,510.000	2,505,959.400	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,876.000	2,016,032.480	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,024.000	1,275,744.320	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,741.000	883,995.750	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	771,960.000	
		HCP INC	39,277.000	1,131,963.140	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,209,618.900	
INVITATION HOMES INC	22,567.000	489,929.570			

	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	631,314.050	
	KIMCO REALTY	32,980.000	536,914.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	513,021.960	
	MID AMERICA	10,258.000	1,031,134.160	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	670,848.350	
	PROLOGIS INC	49,313.000	3,332,079.410	
	PUBLIC STORAGE	12,755.000	2,631,994.250	
	REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,398,606.600	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	736,933.500	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,444.000	1,619,740.440	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,000.000	4,717,250.000	
	SL GREEN	7,097.000	674,285.970	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	460,795.680	
	UDR INC	21,658.000	884,512.720	
	VENTAS INC	30,244.000	1,816,757.080	
	VEREIT INC	72,429.000	556,979.010	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	855,502.660	
	WELLTOWER INC	31,178.000	2,166,247.440	
	WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,709,044.170	
	WP CAREY INC	12,000.000	774,840.000	
アメリカ・ドル 小計		985,404.000	58,021,706.640 (6,610,993,254)	
イギリス・債券	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	449,050.000	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	260,665.350	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	509,232.560	
	SEGRO PLC	82,914.000	524,182.300	
イギリス・債券 小計		272,463.000	1,743,130.210 (256,919,962)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	223,128.480	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	238,682.250	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	80,532.580	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	542,343.310 (46,825,921)	
ユーロ	COVIVIO	2,343.000	209,932.800	
	GECINA SA	3,670.000	482,972.000	
	ICADE	2,234.000	168,220.200	
	KLEPIERRE	17,042.000	528,302.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	11,572.000	1,872,349.600	
ユーロ 小計		36,861.000	3,261,776.600 (420,638,710)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,772,000.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	11,772,000.000 (171,282,600)	
投資証券 合計		1,481,233	7,506,660,447 (7,506,660,447)	

合計		8,276,318,329 (8,276,318,329)	
----	--	----------------------------------	--

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 595銘柄	65.96%	-%	-%	68.59%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	1.97%	
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	6.39%	-%	-%	6.53%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.08%	
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	2.37%	-%	-%	2.59%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.19%	-%	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.58%	-%	-%	3.63%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42%	-%	-%	0.47%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.17%	-%	-%	3.20%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.98%	-%	-%	0.99%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.63%	-%	-%	0.63%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.08%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.28%	-%	-%	0.28%
ユーロ	株式 238銘柄	11.48%	-%	-%	11.72%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.14%	-%	-%	1.20%
	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。



## 「外国債券パッシブ・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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,336,391,650	2,105,552,947
コール・ローン		624,002,470	954,492,032
国債証券		216,308,803,059	194,609,754,212
未収利息		1,887,079,130	1,711,688,419
前払費用		91,755,725	31,665,856
流動資産合計		220,248,032,034	199,413,153,466
資産合計		220,248,032,034	199,413,153,466
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	1,747,163
未払解約金		560,760,000	101,049,000
流動負債合計		560,760,000	102,796,163
負債合計		560,760,000	102,796,163
純資産の部			
元本等			
元本	1	122,096,555,373	110,155,158,834
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		97,590,716,661	89,155,198,469
元本等合計		219,687,272,034	199,310,357,303
純資産合計		219,687,272,034	199,310,357,303
負債純資産合計		220,248,032,034	199,413,153,466

## 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	<p>国債証券</p> <p>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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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30年5月11日現在	平成30年11月12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	131,078,230,921円	122,096,555,373円
同期中追加設定元本額	16,729,345,383円	10,569,658,735円
同期中一部解約元本額	25,711,020,931円	22,511,055,274円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,050,049,463円	7,915,360,922円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	13,305,363円	12,133,962円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	37,652,944円	32,122,507円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	45,093,101円	40,079,067円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	78,626,946円	83,910,052円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	80,011,315円	86,584,078円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	44,833,056円	49,368,545円
たわらノーロード 先進国債券	1,833,616,270円	2,940,262,150円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	35,774,529円	100,951,228円
たわらノーロード バランス（堅実型）	628,907円	1,917,078円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,988,578円	10,544,823円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,191,077円	3,286,058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）	109,755円	290,922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）	5,502,203円	17,722,034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)	4,431,872円	29,940,027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)	853,361円	8,676,579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	4,256,713円
たわらノーロード 最適化バランス(安 定型)	89,471円	134,384円
たわらノーロード 最適化バランス(安 定成長型)	403,528円	1,126,421円
たわらノーロード 最適化バランス(成 長型)	233,604円	449,855円
たわらノーロード 最適化バランス(積 極型)	341,495円	823,431円
D I A M外国債券インデックスファンド < D C年金>	5,073,038,689円	5,160,699,816円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型	491,188,985円	511,964,723円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型	1,595,478,359円	1,661,755,217円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型	1,699,272,358円	1,750,349,034円
D I A M D C バランス30インデッ クスファンド	373,223,365円	373,728,992円
D I A M D C バランス50インデッ クスファンド	800,088,859円	812,438,672円
D I A M D C バランス70インデッ クスファンド	626,109,377円	636,479,194円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配 型>	23,962,825円	22,797,155円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	599,670,192円	599,232,045円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	17,303,931円	11,297,386円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	18,007,015円	116,556,212円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	42,422,763円	67,061,918円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	78,399,336円	112,693,813円
クルーズコントロール	3,040,183,986円	1,850,826,473円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	73,287,083円	81,966,152円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	132,754,072円	145,173,468円
クルーズコントロール< D C年金>	1,195,657円	1,241,313円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実 型)	8,793,931円	5,013,879円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極 型)	27,540,877円	14,227,355円
ダイナミック・ナビゲーション	358,265円	466,343円
4資産分散投資・スタンダード< D C年 金>	5,440,115円	15,349,943円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	11,075円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,370,643,849円	1,282,311,699円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,972,143,836円	6,906,136,345円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,074,076,473円	4,131,847,245円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	3,312,147,806円	3,093,632,320円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	6,092,071,090円	6,086,944,314円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	105,057,530円	94,900,652円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	910,853,702円	776,608,281円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	693,145,902円	634,255,811円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	55,826,267円	49,994,002円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	105,474,980円	90,162,565円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	25,650,246円	22,987,258円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,657,991円	7,331,776円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	67,846,160円	63,485,206円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	82,558,475円	76,570,991円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,652,549,269円	3,385,788,671円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,411,074,987円	2,215,527,454円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,082,018,848円	3,796,928,227円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	732,897,527円	668,691,722円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	397,770,899円	257,273,216円
DIAM 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)	3,434,426,589円	3,126,038,518円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	6,067,800,616円	2,155,232,578円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	13,975,529円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	31,623,028円	15,876,290円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	1,274,515,171円	141,611,143円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	14,916,192,755円	9,862,388,044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 )	19,568,622,784円	18,826,170,467円
D I A Mバランス30 V A ( 適格機関投 資家限定 )	21,219,239円	19,907,057円
D I A Mバランス50 V A ( 適格機関投 資家限定 )	1,447,528円	995,968円
D I A Mバランス70 V A ( 適格機関投 資家限定 )	5,503,464円	5,427,237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 )	17,425,048,455円	16,846,392,413円
D I A M世界バランス25 V A ( 適格機 関投資家限定 )	104,877,846円	99,088,133円
D I A Mバランス20 V A ( 適格機関投 資家限定 )	113,246,173円	108,275,368円
D I A Mバランス40 V A ( 適格機関投 資家限定 )	363,474円	361,861円
D I A Mバランス60 V A ( 適格機関投 資家限定 )	163,595円	163,047円
計	122,096,555,373円	110,155,158,834円
2 . 受益権の総数	122,096,555,373口	110,155,158,834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29年11月14日 至 平成30年5月11日	自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12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、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。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(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。</p>	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
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つた場合、当該価額が異なることもあります。	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つた場合、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等は、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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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）
国債証券	659,526,735	3,088,509,283
合計	659,526,735	3,088,509,283

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月22日から平成30年5月11日まで及び平成30年2月22日から平成30年11月12日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成30年5月11日 現在				平成30年11月12日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	-	-	-	-	467,720,000	-	465,972,837	1,747,163
アメリカ・ドル	-	-	-	-	110,080,000	-	110,022,058	57,942
ユーロ	-	-	-	-	357,640,000	-	355,950,779	1,689,221
合計	-	-	-	-	467,720,000	-	465,972,837	1,747,163

## （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ではありません。



( 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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.7993円	1.8094円
( 1万口当たり純資産額 )	( 17,993円 )	( 18,094円 )

## 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11月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,380,855.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,597,068.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,787,750.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,451,134.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,173,496.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,744,040.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	10,788,728.200	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,420,130.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,497,960.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,454,727.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,209,210.000	
		US T N/B 1.5 10/31/19	5,180,000.000	5,118,668.800	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	4,962,430.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,642,010.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	4,981,576.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,030,130.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	11,050,000.000	10,465,897.000	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,288,569.800	
		US T N/B 1.75 01/31/23	10,000,000.000	9,491,400.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,229,192.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,113,728.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,622,070.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	10,230,000.000	9,752,054.400	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,864,520.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,780,580.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,620,528.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,820,810.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,505,840.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,394,585.600	
		US T N/B 2.0 02/15/22	11,730,000.000	11,368,012.200	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,108,790.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	8,906,250.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,715,000.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	6,180,000.000	5,844,426.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,386,830.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,898,720.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,105,368.000			
US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,429,010.000			
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,303,125.000			
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,333,055.900			

US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,910,500.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,930,000.000	8,412,327.900	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,210,535.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,751,180.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,958,270.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,761,700.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,780,000.000	6,430,897.800	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,880,000.000	12,545,892.800	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,718,080.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,000,000.000	7,472,480.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,313,125.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,434,320.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,573,945.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	8,590,000.000	8,192,025.300	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,615,000.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	8,100,000.000	7,512,102.000	
US T N/B 2.25 12/31/23	6,610,000.000	6,357,431.900	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	5,958,555.600	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,567,585.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,202,392.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	3,802,140.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,340,000.000	2,808,973.400	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	997,519.200	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,740,530.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,696,000.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,806,240.000	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	3,967,147.200	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,787,422.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,416,180.000	
US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,202,640.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	5,962,500.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	8,040,000.000	7,920,606.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	5,742,642.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	5,810,000.000	5,694,206.700	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,231,152.400	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	772,778.000	
US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,416,670.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,509,276.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	4,420,000.000	3,900,650.000	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,142,527.800	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,602,968.800	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	9,864,000.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,043,000.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,230,000.000	2,845,920.700	
US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	6,938,653.600	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	3,546,552.800	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,340,472.100	
US T N/B 2.875 08/15/28	2,650,000.000	2,580,013.500	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,452,875.000	

US T N/B 2.875 10/31/23	6,010,000.000	5,963,963.400	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	3,987,808.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	4,430,000.000	4,116,090.200	
US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	3,724,449.600	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	919,514.400	
US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,659,350.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	4,680,000.000	4,348,000.800	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,500,000.000	3,242,960.000	
US T N/B 3.0 10/31/25	4,480,000.000	4,446,400.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	4,757,739.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,630,627.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,727,010.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,485,626.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,029,040.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,131,456.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,391,160.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,728,270.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	3,902,336.400	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,023,560.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,334,827.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,125,160.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	15,300,000.000	15,446,421.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,580,135.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,510,000.000	4,689,678.400	
US T N/B 3.625 08/15/43	2,790,000.000	2,898,977.400	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,121,560.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,120,000.000	4,369,754.400	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,267,832.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	720,000.000	818,546.400	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,276,080.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	865,132.500	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,312,340.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,318,740.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	1,918,711.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,230,000.000	1,429,875.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,289,662.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,643,684.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,745,786.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,192,202.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	990,432.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,177,500.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,761,555.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,826,595.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,311,827.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,360,000.000	2,801,744.800	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,721,664.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,807,190.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,141,640.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,862,260.000	

アメリカ・ドル 小計		814,710,000.000 (92,828,057,400)	791,481,750.600 (90,181,430,663)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,311,742.000	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,360,000.000	1,339,586.400	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,730,000.000	2,696,148.000	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,740,419.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,970,000.000	1,999,825.800	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,400,000.000	2,172,480.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	820,000.000	829,618.600	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,010,000.000	940,360.500	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,530,000.000	1,484,559.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,087,300.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,250,000.000	1,221,750.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	930,000.000	978,108.900	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,955,680.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,000,000.000	2,419,020.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,179,960.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,600,000.000	3,266,640.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,300,000.000	3,024,270.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,720,000.000	2,645,188.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,780,000.000	2,605,564.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,054,831.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,998,832.500		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,600,000.000	2,591,840.000		
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,202,620.000		
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,329,060.000		

	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,423,870.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,550,000.000	2,175,735.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,117,435.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,780,000.000	2,528,668.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,930,000.000	2,888,824.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,560,000.000	2,411,448.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,940,000.000	3,170,542.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,680,000.000	2,308,152.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,720,000.000	2,571,228.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	2,019,750.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,384,571.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,500,980.300	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,927,395.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,009,978.000	
	イギリス・ポンド 小計	71,950,000.000 (10,604,710,500)	87,513,980.000 (12,898,685,512)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,026,969.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,760,654.400	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,465,658.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	889,323.600	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,149,321.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	866,880.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,898,811.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,698,083.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,554,493.200	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,189,700.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,230,262.000	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,236,896.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	913,941.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,311,600.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	3,995,712.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,777,500.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,158,648.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,402,030.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,935,155.000	
オーストラリア・ドル 小計		44,840,000.000 (3,689,883,600)	47,461,637.200 (3,905,618,125)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,421,130.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	1,090,000.000	1,051,348.600	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,334,264.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	573,834.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	708,520.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	759,336.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,278,449.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,209,403.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,585,573.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,128,506.000	
	CANADA 1.75 05/01/20	2,770,000.000	2,749,169.600	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	976,537.800	
	CANADA 2.0 12/01/51	150,000.000	132,538.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,479,480.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,603,696.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	3,945,825.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,518,295.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	803,325.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,802,836.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,851,744.000	
CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,254,236.000		
CANADA 4.0 06/01/41	1,400,000.000	1,748,348.000		
CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	1,907,654.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,076,480.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,260,000.000	1,750,795.200		
カナダ・ドル 小計		42,350,000.000 (3,656,499,000)	44,651,323.700 (3,855,195,288)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	975,100.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	184,320.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	499,400.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	640,200.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	537,075.000	

	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	410,600.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	470,580.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	838,350.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,652,320.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,367,362.800	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	514,752.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	970,020.000	
シンガポール・ドル 小計		8,900,000.000 (735,318,000)	9,060,079.800 (748,543,793)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	5,016,718.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,282,170.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,377,351.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,333,096.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,580,800.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,528,042.100	
スウェーデン・クローナ 小計		48,040,000.000 (602,421,600)	54,118,177.100 (678,641,941)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,222,190.900	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,955,950.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,552,421.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,339,650.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	13,930,000.000	23,820,021.400	
デンマーク・クローネ 小計		49,030,000.000 (847,728,700)	61,890,233.300 (1,070,082,134)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,865,600.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	3,922,796.700	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,797,112.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,742,044.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,618,934.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,570,000.000 (372,195,000)	27,946,486.700 (377,277,570)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,201,980.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,138,249.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,026,000.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,358,505.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,053,630.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,855,610.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	960,000.000	925,200.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,378,375.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,322,735.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	4,900,000.000	5,248,390.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,763,712.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,617,984.000	
POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,094,552.000		
ポーランド・ズロチ 小計		36,460,000.000	37,984,922.000	



		(1,096,352,200)	(1,142,206,605)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,957,520.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,203,456.800	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,199,098.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,439,444.000	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,940,680.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,113,780.800	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	782,880.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,770,746.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,052,320.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,453,911.200	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,713,304.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,121,391.800	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,805,760.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,000,520.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,717,168.000	
マレーシア・リングgit 小計		33,430,000.000 (910,633,200)	33,271,980.600 (906,328,752)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	14,129,570.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	37,074,100.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	12,461,946.120	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	24,306,880.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,143,700.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,189,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,077,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	19,144,620.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,244,420.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	29,779,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,444,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	13,626,760.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	30,146,260.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	14,221,350.000	
	メキシコ・ペソ 小計		270,859,000.000 (1,535,770,530)	259,989,606.120 (1,474,141,067)
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	500,000.000	499,325.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,333,046.000	

AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	350,997.500	
AUSTRIA 09/20/22	1,790,000.000	1,805,626.700	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,064,330.000	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	234,301.000	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	264,900.500	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,364,850.000	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,525,720.000	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	111,890.000	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,071,306.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,132,704.000	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,720,740.000	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,113,370.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,364,640.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,406,201.600	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,827,670.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,480,000.000	2,213,488.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,464,188.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,712,039.500	
BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	150,975.000	
BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,085,450.800	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,150,000.000	1,182,499.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,109,977.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	690,000.000	688,537.200	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,551,930.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,287,130.000	
BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	511,504.500	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	437,540.400	
BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	868,752.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	800,000.000	854,440.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	716,450.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,881,509.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	280,000.000	300,543.600	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,714,076.500	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,054,535.500	
BELGIUM 3.75 06/22/45	990,000.000	1,428,500.700	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,377,364.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,718,160.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,291,667.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,740,000.000	2,619,291.600	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,120,505.200	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,287,564.500	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,551,180.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,050,000.000	3,162,227.500	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,500,000.000	3,581,050.000	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,525,125.000	
BUNDESUBL 04/08/22	3,000,000.000	3,042,900.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,200,000.000	2,229,480.000	
BUNDESUBL 10/07/22	2,730,000.000	2,767,018.800	

DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,680,000.000	2,684,207.600	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,360,000.000	1,339,668.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,269,586.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,690,000.000	2,766,207.700	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,241,050.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,750,301.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,763,628.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,761,070.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,661,000.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,060,000.000	1,115,978.600	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,262,162.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,700,025.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,177,800.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,768,387.500	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,650,000.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,912,544.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,910,627.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,659,750.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,421,004.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,153,663.300	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,347,400.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,629,691.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,673,944.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,181,200.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,467,079.000	

DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,466,634.500	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,420,000.000	3,736,262.200	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,540,000.000	2,532,068.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	2,013,418.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,200,000.000	3,524,114.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,480,000.000	2,618,504.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,500,000.000	2,382,465.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,370,256.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,263,329.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,795,706.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,721,350.400	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	508,485.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	605,514.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	298,554.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	443,704.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	312,345.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	323,164.800	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	230,584.200	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	426,791.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,018,637.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	428,556.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	752,338.400	
FINLAND 2.625 07/04/42	560,000.000	732,536.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	755,174.700	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,035,536.600	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	767,522.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	998,672.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,351,780.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,939,340.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,754,279.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,560,000.000	3,577,835.600	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,590,000.000	3,598,616.000	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	1,370,000.000	1,365,163.900	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,905,548.000	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,535,225.500	

FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,024,450.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,350,000.000	3,464,737.500	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,000,000.000	3,134,640.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	400,000.000	403,472.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,840,000.000	2,816,144.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,980,000.000	5,272,575.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,763,088.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,206,037.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,272,948.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,922,910.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,970,000.000	2,121,650.600	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,473,000.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,725,788.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,581,408.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,800,000.000	8,258,562.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,745,600.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,898,688.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,700,000.000	3,686,364.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,754,684.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	6,500,000.000	6,882,525.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,430,000.000	4,220,272.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,640,000.000	5,115,507.200	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,760,000.000	2,822,688.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,400,000.000	2,300,844.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,630,000.000	3,864,206.400	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,057,100.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,620,000.000	5,758,442.600	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,763,987.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,387,217.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,390,000.000	5,472,443.100	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,034,683.000	
IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	980,219.500	
IRISH 0.9 05/15/28	340,000.000	337,657.400	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,226,760.000	
IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	441,486.000	

IRISH 1.7 05/15/37	650,000.000	657,429.500	
IRISH 2.0 02/18/45	960,000.000	1,004,409.600	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,241,625.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,085,589.000	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	817,705.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,211,360.000	
IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	940,610.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,645,849.800	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,632,663.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	1,925,532.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,563,388.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	935,351.200	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,358,250.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,752,520.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,440,875.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	450,000.000	410,958.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,458,540.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	1,868,479.800	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,292,275.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,360,950.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,260,000.000	1,838,125.800	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	2,008,230.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,130,000.000	1,023,248.900	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,010,000.000	1,885,420.200	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,780,000.000	2,539,335.400	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,220,020.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,040,000.000	1,892,916.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,241,100.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	961,389.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	954,644.900	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,353,330.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	830,000.000	664,415.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	650,000.000	618,657.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	800,000.000	706,480.000	

ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	1,807,480.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,313,683.800	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,570,000.000	2,579,894.500	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,468,795.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,416,150.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,361,280.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	1,993,233.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,020,000.000	3,145,632.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	3,881,633.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,796,788.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,696,560.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,595,468.300	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,309,184.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,519,938.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,089,620.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,663,401.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,689,680.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,790,000.000	2,010,599.600	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	3,190,000.000	3,486,670.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,685,888.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,241,840.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,430,000.000	2,801,304.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,490,000.000	2,863,749.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,376,470.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,355,442.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,794,375.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	2,952,960.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	3,863,530.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,109,490.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,317,860.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,465,250.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,174,488.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,709,741.000	

NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,726,690.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,488,932.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	950,000.000	968,905.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,060,000.000	1,073,101.600	
NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,682,704.800	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,178,720.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,735,281.600	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,697,839.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,480,000.000	1,819,068.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,350,000.000	1,891,633.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,048,250.600	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,786,532.600	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	689,710.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,540,000.000	2,422,389.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,586,550.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,327,360.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	401,012.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	900,000.000	891,135.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,214,674.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	800,000.000	803,960.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,735,989.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,150,169.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,000,000.000	2,001,440.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	5,460,000.000	5,577,990.600	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,370,000.000	2,343,266.400	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,550,000.000	1,522,456.500	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,540,000.000	2,537,561.600	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,000,000.000	2,014,000.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,599,400.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	1,884,154.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,270,912.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,248,218.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,480,000.000	1,527,360.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	600,000.000	597,936.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	2,996,865.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	1,891,134.000	



	SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,113,430.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	1,997,126.400	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,551,992.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	2,536,926.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,721,636.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,209,622.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,923,347.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,660,064.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,185,273.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,841,400.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,517,120.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,230,500.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,383,828.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,092,444.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,930,000.000	2,816,815.700	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,720,371.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,352,925.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,750,000.000	3,885,585.000	
ユーロ 小計		522,620,000.000 (67,397,075,200)	591,353,447.000 (76,260,940,525)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	26,849,750.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,331,601.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,090,292.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,365,840.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	9,734,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,668,948.800	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	8,864,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,576,143.400	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,822,000.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	17,845,386.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	11,462,412.600	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,271,120.000	
南アフリカ・ランド 小計		157,870,000.000 (1,253,487,800)	139,881,893.800 (1,110,662,237)	
国債証券 合計		185,530,132,730 (185,530,132,730)	194,609,754,212 (194,609,754,212)	
合計		185,530,132,730 (185,530,132,730)	194,609,754,212 (194,609,754,212)	

- (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	組入債券 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	国債証券 138銘柄	45.25%	46.34%
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	6.47%	6.63%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	1.96%	2.01%
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	1.93%	1.98%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.38%	0.38%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.34%	0.35%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.54%	0.55%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.19%	0.19%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.57%	0.59%
マレーシア・リングgit	国債証券 15銘柄	0.45%	0.47%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.74%	0.76%
ユーロ	国債証券 266銘柄	38.26%	39.19%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.56%	0.57%

(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。

## 「外国リート・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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		123,936,938	110,595,617
コール・ローン		92,287,989	55,860,454
投資信託受益証券		5,690,828,513	4,098,263,934
投資証券		44,253,670,488	43,679,115,631
派生商品評価勘定		74,190	15,774
未収入金		58,294,875	751,182
未収配当金		105,456,379	79,358,762
流動資産合計		50,324,549,372	48,023,961,354
資産合計		50,324,549,372	48,023,961,354
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		56,680	767,919
未払金		8,038,801	7,555,692,774
未払解約金		119,023,000	26,529,000
流動負債合計		127,118,481	7,582,989,693
負債合計		127,118,481	7,582,989,693
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,901,256,046	32,380,716,641
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		7,296,174,845	8,060,255,020
元本等合計		50,197,430,891	40,440,971,661
純資産合計		50,197,430,891	40,440,971,661
負債純資産合計		50,324,549,372	48,023,961,354

## 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	<p>投資信託受益証券</p> <p>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</p> <p>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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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>
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>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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30年5月11日現在	平成30年11月12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	42,851,516,844円	42,901,256,046円
同期中追加設定元本額	20,322,961,835円	16,959,148,581円
同期中一部解約元本額	20,273,222,633円	27,479,687,986円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国RE I Tインデックス ファンド<為替ヘッジなし>（ファンド ラップ）	238,155,660円	247,018,095円
D I A M先進国RE I Tインデックス ファンド<為替ヘッジあり>（ファンド ラップ）	89,866,857円	95,000,203円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	5,363,831円	4,347,931円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	21,023,866円	16,225,550円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	40,191,198円	32,145,399円
グローバル8資産ラップファンド（安定 型）	31,704,050円	30,075,924円

グローバル8資産ラップファンド(中立型)	45,211,021円	43,636,068円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	40,331,527円	39,542,249円
たわらノーロード 先進国リート	2,067,601,336円	2,919,089,293円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	505,888,442円	587,949,809円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	132,333,674円	139,841,355円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	55,607,742円	148,527,894円
たわらノーロード バランス(堅実型)	326,068円	948,570円
たわらノーロード バランス(標準型)	5,808,254円	19,742,724円
たわらノーロード バランス(積極型)	22,217,548円	58,616,516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)	2,223,990円	5,826,881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)	10,033,896円	44,302,872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)	8,287,317円	38,523,910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)	21,724,009円	106,999,993円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	96,698円	113,261円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	873,434円	1,666,588円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	982,411円	1,235,067円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,497,985円	4,635,030円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,205,250円	23,065,104円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	605,308,573円	604,869,987円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	64,548,816円	39,383,601円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	29,745,247円	172,886,995円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	101,335,190円	150,229,482円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	222,447,083円	302,213,922円
投資のソムリエ	6,884,778,621円	4,628,532,859円
投資のソムリエ<DC年金>	497,965,893円	409,145,240円
D I A M 8資産バランスファンドN< DC年金>	119,939,477円	121,087,214円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制 型	83,037,311円	137,923,789円
ダイナミック・ナビゲーション	295,228円	696,990円
リスク抑制世界8資産バランスファン ド	1,442,057,323円	2,531,096,042円
ワールドアセットバランス(基本コー ス)	1,433,453,250円	1,200,908,193円
ワールドアセットバランス(リスク抑制 コース)	5,456,447,773円	2,914,300,230円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,464,452円	2,396,757円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,078,542円	1,747,160円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	399,887円	800,629円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,821,622円	3,412,895円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	856,495,571円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	12,333円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,192,999,535円	1,103,861,552円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	27,686,808円	30,245,832円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	1,779,213,080円	575,447,932円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	12,039,870,878円	7,280,385,124円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,856,690,775円	488,601,122円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	1,465,670,521円	258,081,123円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,647,231,593円	3,386,407,330円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	559,632,176円	558,890,123円
計	42,901,256,046円	32,380,716,641円
2. 受益権の総数	42,901,256,046口	32,380,716,641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29年11月14日 至 平成30年5月11日	自 平成30年5月12日 至 平成30年11月12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、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。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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	平成30年5月11日現在	平成30年11月12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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	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つた場合、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等は、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30年5月11日現在	平成30年11月12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）
投資信託受益証券	75,293,346	53,631,819
投資証券	663,140,016	25,045,557
合計	587,846,670	78,677,376

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成30年5月11日まで及び平成30年6月23日から平成30年11月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年5月11日 現在				平成30年11月12日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	78,150,960	-	78,130,200	20,760	-	-	-	-
アメリカ・ドル	16,490,550	-	16,419,000	71,550	-	-	-	-
カナダ・ドル	61,660,410	-	61,711,200	50,790	-	-	-	-
買 建	27,368,250	-	27,365,000	3,250	8,621,642,505	-	8,620,890,360	752,145
アメリカ・ドル	27,368,250	-	27,365,000	3,250	6,266,150,000	-	6,265,600,000	550,000
イギリス・ポンド	-	-	-	-	482,975,729	-	482,964,260	11,469
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	588,302,000	-	588,302,000	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	160,573,800	-	160,573,800	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	280,928,740	-	280,840,000	88,740
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	37,598,680	-	37,597,700	980
ユーロ	-	-	-	-	616,413,026	-	616,428,800	15,774
香港・ドル	-	-	-	-	188,700,530	-	188,583,800	116,730
合計	105,519,210	-	105,495,200	17,510	8,621,642,505	-	8,620,890,360	752,145

## （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ではありません。

## （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30年5月11日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1,170円	1,248円
（1万口当たり純資産額）	（11,701円）	（12,489円）

## 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11月12日現在

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	ABACUS PROPERTY GROUP	107,540.000	357,032.800	
		ARENA REIT	76,763.000	172,716.750	
		BWP TRUST	156,735.000	542,303.100	
		CHARTER HALL GROUP	145,219.000	1,029,602.710	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	57,142.000	238,282.140	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	101,709.000	441,417.060	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	463,689.000	477,599.670	
		DEXUS	320,834.000	3,230,798.380	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	72,764.000	211,743.240	
		GDI PROPERTY GROUP	150,067.000	188,334.080	
		GOODMAN GROUP	508,766.000	5,316,604.700	
		GPT GROUP	570,742.000	3,013,517.760	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	75,592.000	273,643.040	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	45,873.000	142,665.030	
		INDUSTRIA REIT	28,737.000	73,854.090	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	60,012.000	177,035.400	
		INVESTA OFFICE FUND	159,118.000	887,878.440	
		MIRVAC GROUP	1,179,001.000	2,593,802.200	
		NATIONAL STORAGE REIT	214,122.000	370,431.060	
		PROPERTYLINK GROUP	137,268.000	161,976.240	
		RURAL FUNDS GROUP	96,422.000	216,949.500	
		SCENTRE GROUP	1,689,285.000	6,807,818.550	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	263,194.000	689,568.280	
STOCKLAND	764,217.000	2,797,034.220			
VICINITY CENTRES	1,008,966.000	2,714,118.540			
VIVA ENERGY REIT	141,043.000	313,115.460			
	オーストラリア・ドル 小計		8,594,820.000	33,439,842.440 (2,751,764,634)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	16,836.000	279,982.680	
	カナダ・ドル 小計		16,836.000	279,982.680 (24,173,705)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	169,995.000	220,993.500	

	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	216,200.000	167,555.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	801,360.000	2,043,468.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	389,615.000	416,888.050	
	CACHE LOGISTICS TRUST	320,180.000	217,722.400	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	884,479.000	1,494,769.510	
	CAPITALAND MALL TRUST	848,560.000	1,807,432.800	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	183,480.000	253,202.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	245,300.000	363,044.000	
	ESR REIT	635,030.000	311,164.700	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	304,300.000	185,623.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	167,700.000	196,209.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	184,900.000	399,384.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	217,980.000	296,452.800	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	485,750.000	510,037.500	
	KEPPEL DC REIT	304,500.000	411,075.000	
	KEPPEL REIT	575,100.000	649,863.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	579,900.000	139,176.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	601,700.000	980,771.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	400,820.000	745,525.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	743,520.000	907,094.400	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	672,000.000	745,920.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	356,620.000	247,850.900	
	PARKWAY LIFE REIT	125,500.000	327,555.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	246,100.000	98,440.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	206,400.000	118,680.000	
	SPH REIT	189,900.000	188,950.500	
	STARHILL GLOBAL REIT	450,300.000	306,204.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	716,490.000	1,253,857.500	
	シンガポール・ドル 小計	12,223,679.000	16,004,909.160 (1,322,325,595)	
投資信託受益証券	合計	20,835,335	4,098,263.934 (4,098,263,934)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	31,690.000	913,939.600

AGREE REALTY CORP	13,435.000	791,590.200	
ALEXANDER'S INC.	1,486.000	473,305.860	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40,727.000	5,068,882.420	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,793.000	582,548.340	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	52,920.000	2,187,712.800	
AMERICAN HOMES 4 RENT	99,280.000	2,037,225.600	
AMERICOLD REALTY TRUST	22,483.000	592,651.880	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	60,704.000	2,770,530.560	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	83,869.000	1,357,839.110	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	28,982.000	149,836.940	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	53,175.000	9,706,032.750	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	6,494.000	59,355.160	
BOSTON PROPERTIES INC	59,428.000	7,384,523.280	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,778.000	86,287.740	
BRANDYWINE REALTY TRUST	69,375.000	999,000.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	116,961.000	1,887,750.540	
BRT APARTMENTS CORP	2,089.000	24,190.620	
CAMDEN PROPERTY TRUST	35,779.000	3,310,988.660	
CARETRUST REIT INC	31,666.000	613,687.080	
CBL & ASSOCIATES	51,866.000	158,709.960	
CEDAR REALTY TRUST INC	24,781.000	94,415.610	
CHATHAM LODGING TRUST	18,160.000	362,110.400	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	23,567.000	699,468.560	
CITY OFFICE REIT INC	10,610.000	118,619.800	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	72,779.520	
COLONY CAPITAL INC	189,966.000	1,164,491.580	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	45,812.000	1,035,809.320	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	5,814.000	174,187.440	
CORECIVIC INC	46,048.000	1,006,148.800	
CORESITE REALTY CORP	14,215.000	1,364,497.850	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,092.000	1,049,608.560	
COUSINS PROPERTIES INC	162,798.000	1,396,806.840	
CUBESMART	71,803.000	2,098,801.690	
CYRUSONE INC	40,397.000	2,214,563.540	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	80,884.000	846,046.640	

DIGITAL REALTY TRUST INC	79,297.000	8,771,834.140	
DOUGLAS EMMETT INC	62,329.000	2,253,193.350	
DUKE REALTY TRUST	137,671.000	3,934,637.180	
EAST GROUP	13,842.000	1,368,558.540	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	19,704.000	355,854.240	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	52,652.000	841,905.480	
EPR PROPERTIES	28,723.000	2,047,662.670	
EQUITY COMMONWEALTH	47,034.000	1,450,528.560	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,350.000	3,350,842.500	
EQUITY RESIDENTIAL	141,686.000	9,560,971.280	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,425.000	6,456,170.250	
EXTRA SPACE STORAGE INC	48,732.000	4,422,429.000	
FARMLAND PARTNERS INC	8,421.000	62,989.080	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	28,326.000	3,644,423.160	
FIRST INDUSTRIAL RT	48,750.000	1,545,862.500	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	103,106.000	2,596,209.080	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26,081.000	704,708.620	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	42,540.000	329,259.600	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	16,441.000	135,145.020	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	77,536.000	2,596,680.640	
GEO GROUP INC	47,285.000	1,037,432.900	
GETTY REALTY CORP	13,265.000	372,481.200	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,531.000	165,416.090	
GLADSTONE LAND CORP	3,683.000	48,247.300	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,145.000	47,745.600	
GLOBAL NET LEASE INC	27,903.000	590,985.540	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	32,807.000	305,433.170	
HCP INC	180,925.000	5,214,258.500	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	48,496.000	1,404,444.160	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	80,160.000	2,110,612.800	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,951.000	198,541.630	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	40,001.000	1,755,643.890	

HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	63,566.000	1,683,227.680	
HOST HOTELS & RESORTS INC	285,583.000	5,397,518.700	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	60,565.000	1,885,994.100	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	29,107.000	290,778.930	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	6,888.000	153,051.360	
INFREIT INC	13,160.000	280,044.800	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,926.000	130,236.260	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	39,714.000	215,647.020	
INVITATION HOMES INC	114,517.000	2,486,164.070	
IRON MOUNTAIN INC	110,295.000	3,614,367.150	
JBG SMITH PROPERTIES	41,891.000	1,635,424.640	
KILROY REALTY CORP	38,831.000	2,746,904.940	
KIMCO REALTY	162,592.000	2,646,997.760	
KITE REALTY GROUP TRUST	32,807.000	533,113.750	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	42,745.000	1,430,675.150	
LEXINGTON REALTY TRUST	83,317.000	700,695.970	
LIBERTY PROPERTY TRUST	57,044.000	2,512,217.760	
LIFE STORAGE INC	18,020.000	1,732,983.400	
LTC PROPERTIES INC	15,466.000	705,404.260	
MACK CALI	35,218.000	725,490.800	
MANULIFE US REIT	394,200.000	307,476.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	8,766.000	76,527.180	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	140,858.000	2,355,145.760	
MID AMERICA	43,843.000	4,407,098.360	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	35,110.000	524,543.400	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,349.000	1,242,197.020	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	60,549.000	2,975,983.350	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	22,125.000	598,038.750	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	27,744.000	152,592.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,608.000	190,615.920	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	19,801.000	326,716.500	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	77,292.000	2,719,132.560	

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,207.000	109,424.070	
PARAMOUNT GROUP INC	80,222.000	1,161,614.560	
PARK HOTELS & RESORTS INC	77,658.000	2,395,749.300	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26,846.000	917,596.280	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	20,315.000	185,882.250	
PHYSICIANS REALTY TRUST	70,596.000	1,206,485.640	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	49,905.000	925,238.700	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	13,325.000	206,804.000	
PROLOGIS INC	242,077.000	16,357,142.890	
PS BUSINESS PARKS	7,745.000	1,062,614.000	
PUBLIC STORAGE	57,637.000	11,893,394.950	
QTS REALTY TRUST INC	19,871.000	804,974.210	
REALTY INCOME CORP	111,632.000	7,006,024.320	
REGENCY CENTERS CORP	65,278.000	4,259,389.500	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	43,935.000	787,754.550	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	85,242.000	1,048,476.600	
RETAIL VALUE INC	5,243.000	148,272.040	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	35,405.000	1,167,656.900	
RLJ LODGING TRUST	67,898.000	1,360,675.920	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	30,438.000	410,608.620	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,863.000	1,504,423.620	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	69,015.000	1,468,639.200	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	2,130.000	39,255.900	
SAUL CENTERS INC	3,831.000	192,967.470	
SELECT INCOME REIT	34,935.000	693,110.400	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	91,984.000	1,496,579.680	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	9,047.000	344,690.700	
SIMON PROPERTY GROUP INC	118,883.000	22,432,033.270	
SITE CENTERS CORP	56,946.000	683,921.460	
SL GREEN	33,379.000	3,171,338.790	
SPIRIT MTA REIT	14,648.000	158,051.920	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	165,993.000	1,359,482.670	
STAG INDUSTRIAL INC	40,544.000	1,070,767.040	
STORE CAPITAL CORP	70,662.000	2,117,033.520	



	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	41,171.000	480,465.570	
	SUN COMMUNITIES INC	33,289.000	3,418,114.520	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	88,420.000	1,329,836.800	
	TANGER FACTORY OUTLET	36,541.000	863,463.830	
	TAUBMAN CENTERS INC	23,632.000	1,299,996.320	
	TERRENO REALTY CORP	22,725.000	885,820.500	
	THE MACERICH COMPANY	40,865.000	2,089,018.800	
	TIER REIT INC	19,976.000	459,847.520	
	UDR INC	103,126.000	4,211,665.840	
	UMH PROPERTIES INC	10,131.000	134,235.750	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,194.000	280,998.000	
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,331.000	925,631.280	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,927.000	182,200.070	
	VENTAS INC	137,156.000	8,238,960.920	
	VEREIT INC	373,201.000	2,869,915.690	
	VICI PROPERTIES INC	27,519.000	597,162.300	
	VORNADO REALTY TRUST	66,680.000	4,671,600.800	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	73,078.000	497,661.180	
	WASHINGTON REIT	30,601.000	876,106.630	
	WEINGARTEN REALTY INVST	46,146.000	1,337,311.080	
	WELLTOWER INC	143,123.000	9,944,186.040	
	WHITESTONE REIT	11,820.000	164,298.000	
	WP CAREY INC	41,366.000	2,671,002.620	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,537.000	892,508.500	
	アメリカ・ドル 小計	8,633,281.000	311,389,141.720 (35,479,678,808)	
	イギリス・ポンド			
	ASSURA PLC	927,458.000	528,651.060	
	BIG YELLOW GROUP PLC	61,088.000	568,118.400	
	BRITISH LAND CO PLC	383,239.000	2,394,477.270	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	169,910.000	67,964.000	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	53,786.000	57,282.090	
	DERWENT LONDON PLC	42,848.000	1,332,144.320	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	212,472.000	202,698.280	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	109,345.000	814,620.250	
	HAMMERSON PLC	306,650.000	1,363,672.550	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	167,124.000	162,110.280	
	INTU PROPERTIES PLC	334,884.000	654,698.220	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	289,651.000	2,497,370.920	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	270,497.000	510,698.330	
	LXI REIT PLC	118,335.000	142,002.000	
	NEWRIVER REIT PLC	121,042.000	290,500.800	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	288,249.000	317,650.390	
	RDI REIT PLC	531,663.000	181,297.080	
	REGIONAL REIT LTD	105,299.000	106,562.580	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	81,935.000	458,836.000	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	152,503.000	91,196.790	
	SEGRE PLC	389,171.000	2,460,339.060	
	SHAFTESBURY PLC	89,450.000	830,543.250	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	114,944.000	119,541.760	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	572,098.000	804,369.780	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	225,559.000	197,138.560	
	UNITE GROUP PLC	102,046.000	881,677.440	
	WORKSPACE GROUP PLC	50,654.000	504,767.110	
イギリス・ボンド 小計		6,271,900.000	18,540,928.570 (2,732,747,462)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	54,949.000	809,948.260	
イスラエル・シュケル 小計		54,949.000	809,948.260 (25,084,098)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	5,891.000	79,881.960	
	ALLIED PROPERTIES REIT	19,205.000	842,139.250	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,536.000	251,494.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,982.000	442,992.240	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	27,614.000	1,312,217.280	
	CHOICE PROPERTIES REIT	53,361.000	657,407.520	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	35,511.000	405,535.620	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	17,914.000	240,585.020	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,279.000	117,379.350	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,098.000	503,790.840	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	13,629.000	136,835.160	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,923.000	283,528.940	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,863.000	498,543.750	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	54,476.000	1,130,921.760	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,040.000	218,793.600	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,590.000	96,986.500	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	11,122.000	288,059.800	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,731.000	227,211.760	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	59,303.000	1,463,005.010	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	90,592.500	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	98,130.520	
	SMARTCENTRES REIT	25,628.000	799,337.320	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	11,161.000	103,797.300	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10,465.000	66,766.700	
カナダ・ドル 小計		509,140.000	10,355,933.700 (894,131,315)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	265,480.000	297,337.600	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	318,045.000	483,428.400	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	451,452.000	609,460.200	
	PRECINCT PROPERTIES	327,125.000	461,246.250	
	STRIDE STAPLED GROUP	112,511.000	210,395.570	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	108,788.000	227,366.920	
ニュージーランド・ドル 小計		1,583,401.000	2,289,234.940 (175,675,889)	
ユーロ	AEDIFICA	7,117.000	543,738.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	61,371.000	767,137.500	
	ALTAREA	1,319.000	259,843.000	
	BEFIMMO	9,037.000	449,138.900	
	BENI STABILI SPA	404,511.000	305,810.310	
	COFINIMMO SA	8,232.000	880,824.000	
	COVIVIO	20,819.000	1,865,382.400	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,926.000	487,972.640	
	GECINA SA	21,144.000	2,782,550.400	
	GREEN REIT PLC	258,537.000	371,776.200	
	HAMBORNER REIT AG	29,596.000	268,731.680	
	HIBERNIA REIT PLC	272,871.000	367,830.100	
	ICADE	17,452.000	1,314,135.600	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	16,157.000	100,480.380	
	IMMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	114,607.000	1,021,148.370	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5,418.000	125,155.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	126,018.000	182,726.100	
	KLEPIERRE	80,038.000	2,481,178.000	

	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	25,122.000	214,541.880	
	MERCIALYS	17,917.000	239,908.630	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	141,645.000	1,616,877.670	
	NSI NV	6,065.000	222,282.250	
	RETAIL ESTATES	2,767.000	200,607.500	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	52,951.000	8,567,471.800	
	VASTNED RETAIL	6,633.000	232,486.650	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,571.000	745,151.400	
	WERELDHAVE NV	15,784.000	477,466.000	
	ユーロ 小計	1,745,625.000	27,092,353.960 (3,493,829,967)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	612,070.000	3,231,729.600	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	435,000.000	3,801,900.000	
	LINK REIT	675,020.000	48,601,440.000	
	PROSPERITY REIT	390,000.000	1,092,000.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	307,000.000	1,485,880.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	430,000.000	2,128,500.000	
	香港・ドル 小計	2,849,090.000	60,341,449.600 (877,968,092)	
投資証券 合計		21,647,386	43,679,115,631 (43,679,115,631)	
合計			47,777,379,565 (47,777,379,565)	

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 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	投資証券 158銘柄	-%	87.73%	74.26%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	6.76%	5.72%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.05%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 26銘柄	6.80%	-%	5.76%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 24銘柄	0.06% -%	-% 2.21%	1.92%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	3.27%	-%	2.77%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	0.43%	0.37%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	8.64%	7.31%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	2.17%	1.84%

(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11月30日現在

資産総額	426,829,747円
負債総額	1,133,136円
純資産総額( - )	425,696,611円
発行済数量	408,912,914口
1口当たり純資産額( / )	1.0410円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産総額	279,817,585,459円
負債総額	314,432,030円
純資産総額( - )	279,503,153,429円
発行済数量	108,741,524,323口
1口当たり純資産額( / )	2.5703円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産総額	346,310,672,060円
負債総額	687,891,000円
純資産総額( - )	345,622,781,060円
発行済数量	268,430,973,463口
1口当たり純資産額( / )	1.2876円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産総額	31,714,514,934円
負債総額	115,463,414円
純資産総額( - )	31,599,051,520円
発行済数量	16,307,222,024口
1口当たり純資産額( / )	1.9377円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産総額	331,882,251,923円
負債総額	378,367,649円
純資産総額( - )	331,503,884,274円
発行済数量	94,892,334,961口
1口当たり純資産額( / )	3.4935円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産総額	198,634,059,958円
負債総額	128,024,000円
純資産総額( - )	198,506,035,958円
発行済数量	109,198,120,308口
1口当たり純資産額( / )	1.8179円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年11月30日現在

資産総額	39,584,435,154円
負債総額	77,565,034円
純資産総額( - )	39,506,870,120円
発行済数量	31,659,990,971口
1口当たり純資産額( / )	1.2478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。

## 第三部【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（2018年11月30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（2018年11月30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。

2018年11月30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	1,205,923,689,410
追加型株式投資信託	854	13,003,927,185,717
単位型公社債投資信託	46	183,614,446,405
単位型株式投資信託	153	1,116,875,953,733
合計	1,091	15,510,341,275,265

### 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33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30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34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）の中間財務諸表について、EY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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	27,972,477	49,071,217
金銭の信託	12,366,219	12,083,824
有価証券	297,560	-
未収委託者報酬	10,164,041	11,769,015
未収運用受託報酬	7,250,239	4,574,225
未収投資助言報酬	316,414	341,689
未収収益	52,278	59,526
前払費用	533,411	569,431
繰延税金資産	678,104	842,996
その他	445,717	427,238
流動資産計	60,076,462	79,739,165
固定資産		
有形固定資産	1,900,343	1,643,826
建物	1 1,243,812	1 1,156,953
器具備品	1 656,235	1 476,504
建設仮勘定	295	10,368
無形固定資産	1,614,084	1,934,700
商標権	5	-
ソフトウェア	1,511,558	1,026,319
ソフトウェア仮勘定	98,483	904,389
電話加入権	3,934	3,931
電信電話専用施設利用権	103	60
投資その他の資産	10,055,336	7,427,316
投資有価証券	3,265,786	1,721,433
関係会社株式	3,306,296	3,229,196
長期差入保証金	1,800,827	1,518,725
前払年金費用	686,322	-
繰延税金資産	893,887	856,537
その他	102,215	101,425
固定資産計	13,569,764	11,005,844
資産合計	73,646,227	90,745,010

（単位：千円）

	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038
未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911
役員賞与引当金	27,495	49,986
本社移転費用引当金	-	156,587
流動負債計	17,211,706	22,211,034
固定負債		
退職給付引当金	1,305,273	1,637,133
時効後支払損引当金	216,466	199,026
本社移転費用引当金	942,315	-
固定負債計	2,464,055	1,836,160
負債合計	19,675,761	24,047,195
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	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	17,124,479
利益剰余金	31,899,643	44,349,855
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	31,776,350	44,226,562
別途積立金	24,580,000	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	6,696,350	19,146,562
株主資本計	53,452,601	65,902,812
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,864	795,002
評価・換算差額等計	517,864	795,002
純資産合計	53,970,465	66,697,815
負債・純資産合計	73,646,227	90,745,010

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	56,355,754		84,705,447	
運用受託報酬	12,834,241		19,124,427	
投資助言報酬	1,002,482		1,217,672	
その他営業収益	378,715		117,586	
営業収益計		70,571,194		105,165,133
営業費用				
支払手数料	24,957,038		37,242,284	
広告宣伝費	838,356		379,873	
公告費	991		1,485	
調査費	15,105,578		23,944,438	
調査費	7,780,474		10,677,166	
委託調査費	7,325,104		13,267,272	
委託計算費	891,379		1,073,938	
営業雑経費	1,102,921		1,215,963	
通信費	51,523		48,704	
印刷費	926,453		947,411	
協会費	37,471		64,331	
諸会費	74		22,412	
支払販売手数料	87,399		133,104	
営業費用計		42,896,265		63,857,984
一般管理費				
給料	8,517,089		11,304,873	
役員報酬	220,145		189,022	
給料・手当	7,485,027		9,565,921	
賞与	811,916		1,549,929	
交際費	66,813		58,863	
寄付金	13,467		5,150	
旅費交通費	297,237		395,605	
租税公課	430,779		625,498	
不動産賃借料	1,961,686		1,534,255	
退職給付費用	358,960		595,876	
固定資産減価償却費	825,593		1,226,472	
福利厚生費	39,792		49,797	
修繕費	27,435		4,620	
賞与引当金繰入額	1,432,264		1,393,911	
役員賞与引当金繰入額	27,495		49,986	
役員退職慰労金	63,072		-	
機器リース料	210		148	
事務委託費	1,530,113		3,037,804	
事務用消耗品費	127,265		144,804	
器具備品費	271,658		5,253	
諸経費	129,981		149,850	
一般管理費計		16,120,918		20,582,772
営業利益		11,554,010		20,724,376

（単位：千円）

	第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		第33期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		537		1,430
受取配当金		51,036		74,278
時効成立分配金・償還金		103		256
為替差益		7,025		8,530
投資信託解約益		2		236,398
投資信託償還益		-		93,177
雑収入	1	18,213	1	10,306
時効後支払損引当金戻入額		-		17,429
営業外収益計		76,918		441,807
営業外費用				
投資信託解約損		31,945		4,138
投資信託償還損		47,201		17,065
金銭の信託運用損		552,635		99,303
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		841,031		120,507
経常利益		10,789,897		21,045,676
特別利益				
固定資産売却益	2	2,348	2	1
投資有価証券売却益		-		479,323
関係会社株式売却益	1	-	1	1,492,680
貸倒引当金戻入益		8,883		-
訴訟損失引当金戻入益		21,677		-
本社移転費用引当金戻入額		-		138,294
その他特別利益		746		350
特別利益計		33,655		2,110,649
特別損失				
固定資産除却損	3	23,600	3	36,992
固定資産売却損	4	10,323	4	134
投資有価証券評価損		12,085		-
ゴルフ会員権評価損		4,832		-
訴訟和解金		30,000		-
本社移転費用	5	1,511,622	5	-
退職給付制度終了損		-		690,899
システム移行損失		-		76,007
その他特別損失		-		50
特別損失計		1,592,463		804,083
税引前当期純利益		9,231,089		22,352,243
法人税、住民税及び事業税		2,965,061		6,951,863
法人税等調整額		177,275		249,832
法人税等合計		2,787,786		6,702,031
当期純利益		6,443,302		15,650,211



## （３）【株主資本等変動計算書】

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
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

第33期(自平成29年4月1日至平成30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	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
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	19,146,562

	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
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

## 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 定率法を採用しております。 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 定額法を採用しております。 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）に基づく定額法を採用しております。</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、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</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。</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、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</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

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、当事業年度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。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度末の減価償却費が413,260千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ同額減少しております。

## 追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
建物	53,098	140,580
器具備品	734,064	847,466

(損益計算書関係)

### 1. 関係会社に対する事項

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
雑収入	8,183	-
関係会社株式売却益	-	1,492,680

### 2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	546	-
車両運搬具	696	-
器具備品	1,104	1

## 3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	-	298
器具備品	4,727	8,217
ソフトウェア	2,821	28,472
電話加入権	16,052	3

## 4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	543	-
器具備品	9,779	134

## 5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	942,315	-
旧日本社不動産賃借料	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

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					

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30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	24,490	-	-	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30年6月20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30年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21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おります。

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（為替予約取引及び株価指数先物取引）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おります。

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（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おります。

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 その他有価証券	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	-

## 第33期(平成30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	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

## (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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	337,468	272,464
関係会社株式	3,306,296	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。



(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 その他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

第33期(平成30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	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

(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32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33期の貸借対照表計上額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

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。

## 第33期(平成30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	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
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	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)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」、「売却益の合計額」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。

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30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	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

(注) 投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」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。

第33期において、該当事項はありません。

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。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

なお、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するとともに、退職一時金制度を改定しました。

## 2. 確定給付制度

## （1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
退職給付債務の期首残高	1,086,550	2,718,372
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
数理計算上の差異の発生額	89,303	61,792
退職給付の支払額	144,062	111,758
合併による増加	1,486,547	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,316,796
退職一時金制度改定に伴う増加額	-	526,345
退職給付債務の期末残高	2,718,372	2,154,607

## （2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
年金資産の期首残高	-	1,363,437
期待運用収益	16,033	17,042
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	36,672
退職給付の支払額	28,876	-
合併による増加	1,336,984	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,417,152
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32期	第33期
	（平成29年3月31日現在）	（平成30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	1,443,026	2,154,607
未積立退職給付債務	1,354,935	2,154,607
未認識数理計算上の差異	430,203	204,636
未認識過去勤務費用	4,852	312,836
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133
退職給付引当金	1,245,019	1,637,133
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	919,879	1,637,133

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の費用処理額	78,229	88,417
過去勤務費用の費用処理額	4,852	39,611
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	-	70,560
その他	7,498	1,620
確定給付制度に係る退職給付費用	274,580	456,577
制度移行に伴う損失(注)	-	690,899

(注) 特別損失に計上しております。

## (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。

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.02% ~ 1.09%	0.09%
長期期待運用収益率	2.50%	-
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 4.42%

## 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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	300,927
退職給付費用	22,562	53,156
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	36,177	35,640
合併による増加	287,313	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	391,600
退職一時金制度改定に伴う振替額	-	108,189
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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30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 22,562千円 当事業年度53,156千円

## 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61,817千円、当事業年度86,141千円であります。

## (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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	124,081	290,493
未払事業所税	11,054	11,683
賞与引当金	441,996	426,815
未払法定福利費	84,152	81,186
資産除去債務	86,421	90,524
減価償却超過額(一括償却資産)	10,666	11,331
減価償却超過額	116,920	176,791
繰延資産償却超過額(税法上)	32,949	34,977
退職給付引当金	399,808	501,290
時効後支払損引当金	66,282	60,941
ゴルフ会員権評価損	14,295	13,173
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	69,683	28,976
未払給与	12,344	9,186
本社移転費用引当金	289,865	47,947
その他	14,309	29,193
繰延税金資産小計	1,941,573	1,981,254
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,941,573	1,981,254
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	159,429	281,720
繰延税金負債合計	369,581	281,720

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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29年4月1日から平成30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	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,059,836千円
負債合計	13,059,836千円
純資産	101,210,659千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額70,507,975千円及び顧客関連資産の金額45,200,838千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	9,012,128千円
経常利益	9,012,128千円
税引前当期純利益	9,012,128千円
当期純利益	7,419,617千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額3,811,241千円及び顧客関連資産の償却額5,233,360千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32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日 至平成30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。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

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。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30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	6,470,802	未払 手数料	894,336
	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	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

## 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) 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3) 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4) 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. 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

該当はありません。

## (1株当たり情報)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
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	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734株)	(15,510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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		34,067,025
金銭の信託		18,936,052
未収委託者報酬		12,755,452
未収運用受託報酬		3,856,616
未収投資助言報酬		346,291
未収収益		58,816
前払費用		722,476
その他		443,661
	流動資産計	71,186,392
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,139,616
器具備品	1	425,343
無形固定資産		
ソフトウェア		875,280
ソフトウェア仮勘定		1,787,307
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		40
投資その他の資産		
投資有価証券		8,242,396
関係会社株式		2,436,769
長期差入保証金		3,229,196
繰延税金資産		1,318,800
繰延税金資産		1,167,835
その他		89,794
	固定資産計	12,473,915
資産合計		83,660,307

(単位:千円)

	第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	2,420,695
未払金	5,448,301
未払収益分配金	1,091
未払償還金	48,968
未払手数料	4,999,441
その他未払金	398,799
未払費用	6,877,637
未払法人税等	3,090,099
未払消費税等	599,967
前受収益	70,778
賞与引当金	1,310,878
役員賞与引当金	25,584
流動負債計	19,843,940
固定負債	
退職給付引当金	1,739,495
時効後支払損引当金	177,842
固定負債計	1,917,338
負債合計	21,761,279
(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	39,054,769
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	38,931,475
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	7,251,475
株主資本計	60,607,726
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,291,302
評価・換算差額等計	1,291,302
純資産合計	61,899,028
負債・純資産合計	83,660,307

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,913,511	
運用受託報酬	8,532,726	
投資助言報酬	628,443	
その他営業収益	58,808	
	営業収益計	52,133,489
営業費用		
支払手数料	18,339,539	
広告宣伝費	179,085	
公告費	125	
調査費	12,096,339	
調査費	4,887,455	
委託調査費	7,208,884	
委託計算費	514,718	
営業雑経費	613,114	
通信費	23,463	
印刷費	467,622	
協会費	31,454	
諸会費	17,206	
支払販売手数料	73,367	
	営業費用計	31,742,923
一般管理費		
給料	4,854,622	
役員報酬	92,217	
給料・手当	4,634,136	
賞与	128,268	
交際費	26,068	
寄付金	5,806	
旅費交通費	164,824	
租税公課	284,716	
不動産賃借料	779,131	
退職給付費用	256,835	
固定資産減価償却費	1 294,442	
福利厚生費	22,384	
修繕費	12,644	
賞与引当金繰入額	1,310,878	
役員賞与引当金繰入額	25,584	
機器リース料	60	
事務委託費	1,757,115	
事務用消耗品費	70,698	
器具備品費	3,043	
諸経費	98,264	
	一般管理費計	9,967,124
営業利益		10,423,441

(単位:千円)

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	887	
受取配当金	49,212	
時効成立分配金・償還金	8,482	
時効後支払損引当金戻入額	19,806	
雑収入	12,895	
営業外収益計		91,283
営業外費用		
為替差損	19,977	
金銭の信託運用損	23,814	
雑損失	3,708	
営業外費用計		47,500
経常利益		10,467,225
特別損失		
固定資産除却損	18,830	
特別損失計		18,830
税引前中間純利益		10,448,394
法人税、住民税及び事業税		2,910,819
法人税等調整額		312,661
法人税等合計		3,223,481
中間純利益		7,224,913

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30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	19,146,562
当中間期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
中間純利益									7,224,913
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
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	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	11,895,086
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	7,251,475

	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	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
中間純利益	7,224,913	7,224,913			7,224,913
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)			496,300	496,300	496,300
当中間期変動額合計	5,295,086	5,295,086	496,300	496,300	4,798,786
当中間期末残高	39,054,769	60,607,726	1,291,302	1,291,302	61,899,028

## 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 定率法を採用しております。 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="587 696 943 770"> <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 定額法を採用しております。 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、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務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）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、それぞれ発生の日次事業年度から費用処理しております。</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>						
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。						



## 表示方法の変更

<p>第34期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）</p>
<p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。</p>

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第34期中間会計期間末 （平成30年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	184,810千円
	器具備品	...	860,618千円

（中間損益計算書関係）

項目	第34期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	112,547千円
	無形固定資産	...	181,894千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30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30年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21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34期中間会計期間末（平成30年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30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	34,067,025	34,067,025	-
(2) 金銭の信託	18,936,052	18,936,052	-
(3) 未収委託者報酬	12,755,452	12,755,452	-
(4) 未収運用受託報酬	3,856,616	3,856,616	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,164,304	2,164,304	-
資産計	71,779,451	71,779,451	-
(1) 未払手数料	4,999,441	4,999,441	-
負債計	4,999,441	4,999,441	-

## (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あります。

## (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あります。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あります。

## (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	272,464
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34期中間会計期間末  
（平成30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	1,976,064	146,101	1,829,962
投資信託	184,247	153,000	31,247
小計	2,160,311	299,101	1,861,209
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	3,993	4,000	6
小計	3,993	4,000	6
合計	2,164,304	303,101	1,861,202

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額272,464千円）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30年4月1日から平成30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	109,432,950千円
資産合計	109,432,950千円
流動負債	- 千円
固定負債	11,942,856千円
負債合計	11,942,856千円
純資産	97,490,094千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額68,602,354千円及び顧客関連資産の金額42,580,212千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	4,521,569千円
経常利益	4,521,569千円
税引前中間純利益	4,521,569千円
中間純利益	3,720,565千円
1株当たり中間純利益	93,014円14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2,620,626千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34期中間会計期間(自平成30年4月1日 至平成30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34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,547,475円72銭
1株当たり中間純利益金額	180,622円83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34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
中間純利益金額	7,224,913千円
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	7,224,913千円
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。

(重要な後発事象)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
<p>アセットマネジメントOne株式会社(取締役社長:菅野 暁、以下「AM-One」)は、平成30年6月1日に株式会社みずほ銀行(頭取:藤原 弘治)と締結した株式譲渡基本合意書に基づき、平成30年11月1日に株式譲渡契約を締結の上、同日付でみずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(取締役社長:安藤 学、以下「MGAI」)の発行済株式の全てを取得し、子会社化しました。本再編に伴いMGAIは、商号をアセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社(取締役社長:安藤 学、以下「AMOAI」)に改称しました。</p>
<p>1. 株式取得の目的</p> <p>本再編により、AM-OneとAMOAI(旧MGAI)は両社のオルタナティブ投資のゲートキーピング( )に係る機能について一体運営を行ない、ゲートキーピング能力と受託体制の強化を実現するとともに、株式会社みずほフィナンシャルグループ及び第一生命ホールディングス株式会社とも連携し、お客様の多様なニーズに応えるものであります。</p> <p>( )外部の運用会社およびファンドを調査し、優良なファンドを選定・管理すること</p>
<p>2. 株式取得対象会社の概要</p> <p>(1) 商号 :アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社</p> <p>(2) 事業内容:投資運用業務、投資助言・代理業務</p> <p>(3) 資本金 :10億円(平成30年11月1日現在)</p>
<p>3. 株式取得の時期</p> <p>平成30年11月1日</p>
<p>4. 取得する株式の数、取得原価及び取得後の議決権比率</p> <p>(1) 取得株式数 :20,000株</p> <p>(2) 取得原価 :12億7千万円</p> <p>(3) 取得後の議決権比率 :100%</p>



#### 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) 通常の見積り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

2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社（以下「MGAI」といいます。）の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社（新商号：アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社）としました。

- (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

2018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
マネックス証券株式会社	12,200	「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2018年3月末日現在

#### (3) 投資顧問会社

##### a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

##### b. 資本金の額

2018年3月末日現在 9,557.5万円

##### c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

### 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) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (6) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

### 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【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法  
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など  
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。  
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法  
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年5月30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30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12月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の平成30年5月12日から平成30年11月12日までの特定期間の財務諸表、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、マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の平成30年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成30年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### EY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30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間(平成30年4月1日から平成30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30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30年4月1日から平成30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) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。