

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年10月13日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	投資のソムリエ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	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】

投資のソムリエ

（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」に記載の振替機関及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】

5,000億円を上限とします。

（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。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あた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、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・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】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、1口単位となります。

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：2020年10月14日から2021年4月12日まで

ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行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、お申込みの受付を行いません。

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。

(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います。

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、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

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】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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を行いません。

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

受益権の取得申込者は委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、委託会社または販売会社は、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、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。

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、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。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 投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

- 主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)にマザーファンド*1を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。
- 外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円で為替ヘッジ*2を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

*1 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・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、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

*2 一部の外貨建資産の通貨については委託会社がその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う[代替ヘッジ]を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

2 基準価額の変動リスク*を年率4%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

*価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

3 年2回決算を行います。

- 毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

運用プロセス

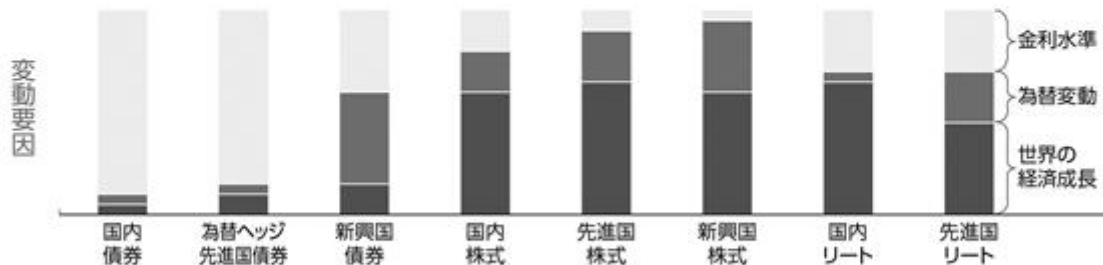
- 基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。
 - 基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。
 - 基本配分戦略は月次で行います。
- ※基本配分戦略に関して、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。
- 機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。
 - 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。
 - 機動的配分戦略は日次で行います。

基本配分戦略 (月次戦略)

資産価格はさまざまな要因により変動し、またその要因も刻々と変化していきます。当ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、この比率を均等に配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率を決定します。

当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

各資産における変動要因と要因の比率(例)



変動要因の比率を均等に配分



着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

変動要因の配分から最適と判断される資産配分の比率を決定



※当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。

機動的配分戦略 (日次戦略)

市場環境に応じて、組入資産を安定資産や現金等*に入れ替えます。

リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、組入資産を安定資産や現金等に入れ替えることで基準価額の下落の抑制をめざします。

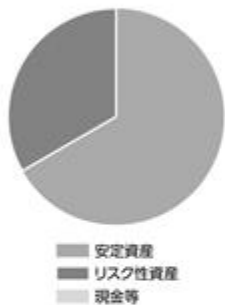
*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等です。

※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

価格下落局面における配分比率変更のイメージ

例

ある時点の基本配分比率



リスク性資産の価格下落局面*1

リスク性資産の比率を下げ、
安定資産の比率を上げる。



安定資産の価格下落局面*1

安定資産の比率を下げ、
現金等の比率を上げる。



安定資産、リスク性資産の価格下落局面*2

安定資産の比率を下げ、
現金等の比率を上げる。



リスク性資産をすべて売却し、
安定資産、現金等の比率を
上げる。

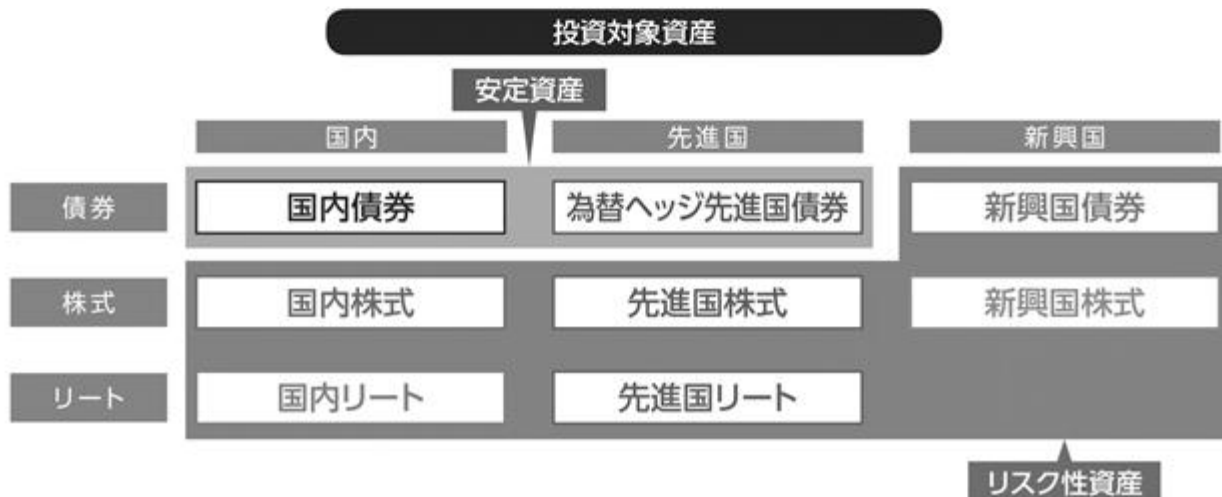
*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。

*2 両資産価格について下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産をすべて売却し、基本配分比率の8資産の合計額のうち半分を現金等に入れ替えます。

※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合があります。

※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。



商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	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) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
不動産投信 その他資産 (投資信託証券(資 産複合(債券、株 式、不動産投信)資 産配分変更型)) 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型	日々 その他 ()	オセアニア 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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

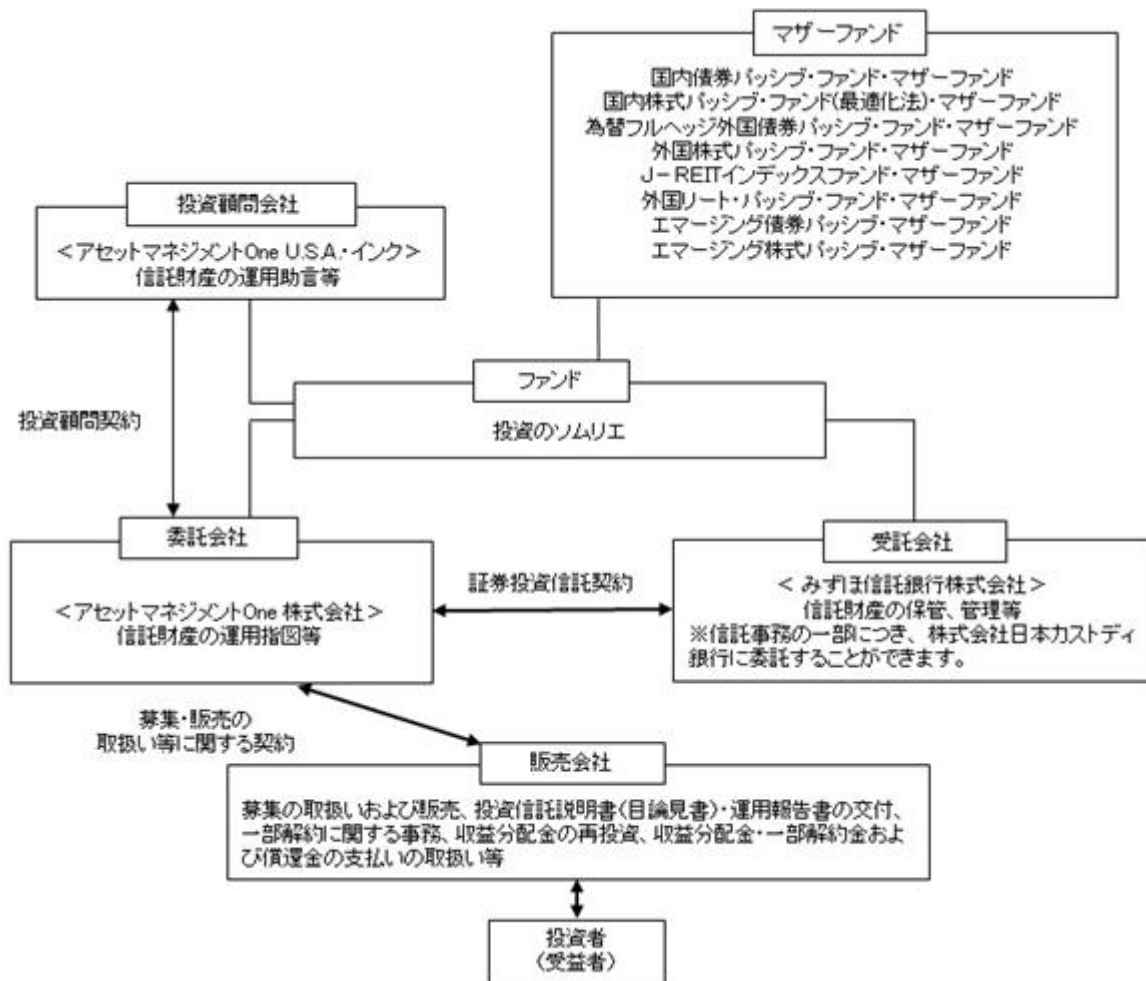
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （債券、株式、 不動産投信） 資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	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。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジ又は一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

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

（２）【ファンドの沿革】

2012年10月26日	信託契約締結、当初設定日、ファンドの運用開始
2013年4月24日	ファンドの名称を「投資のコンシェルジュ」から「投資のソムリエ」に変更
2013年5月17日	投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

(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、当ファンドにかかる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、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、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（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）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。



当ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産に投資する場合があります。

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（2020年7月31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ルユ・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

(2020年7月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」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」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)、短期金融資産に投資する場合があります。

<投資態度>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

・国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

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

- ・ 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・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
- ・ J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- ・ 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・ エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・ エマージング株式パッシブ・マザーファンド

(それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。)

・ 外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ^{*}を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

* 一部の外貨建資産の通貨については、委託会社はその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

・ 上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)、短期金融資産へ投資する場合があります。

基準価額の変動リスク^{*}を年率4%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

* 価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

・ 基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。

・ 基本配分戦略は月次で行います。

機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

・ 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。

・ 機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16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項に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かかる権利(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22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)

八.金銭債権

二.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・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、J・REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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、ならびに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総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 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。)
7. 投資法人債券(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、振替投資法人債を含みます。)
8. 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。)
9. 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。)
10. 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。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 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
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの

14. 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、振替受益権を含みます。)
15. 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。)
16. 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。)
17. 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、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 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。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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。)
21. 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。)
22. 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
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.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、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、上記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の指図をすることができます。

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

(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、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 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。 2. 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。 3. 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。

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。

運用プロセス

1.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。

2.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

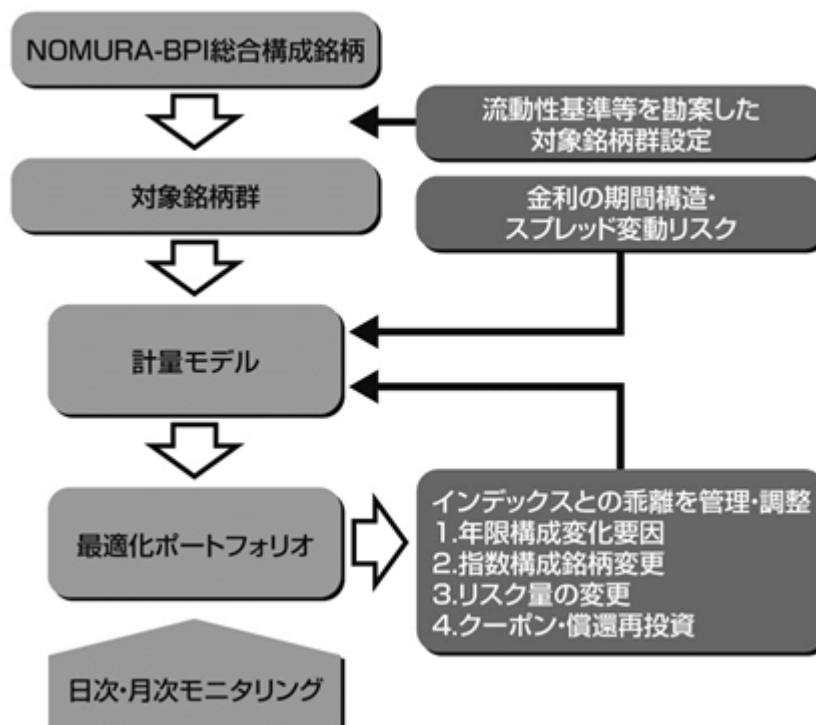
1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3.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
- ・ クーポン、償還再投資



<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 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ませす。 2. 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。 3. 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。 4. 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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 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。 6. 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。 7. 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。 8. 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</p>	<p>国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<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）に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>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	<ol style="list-style-type: none">1.主として東京証券取引所第1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。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したリスク管理を行います。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。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。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。
------	---

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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。

㈱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。

㈱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。

㈱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、㈱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。

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、㈱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。

㈱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。

㈱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。

以上の項目に限らず、㈱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。

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

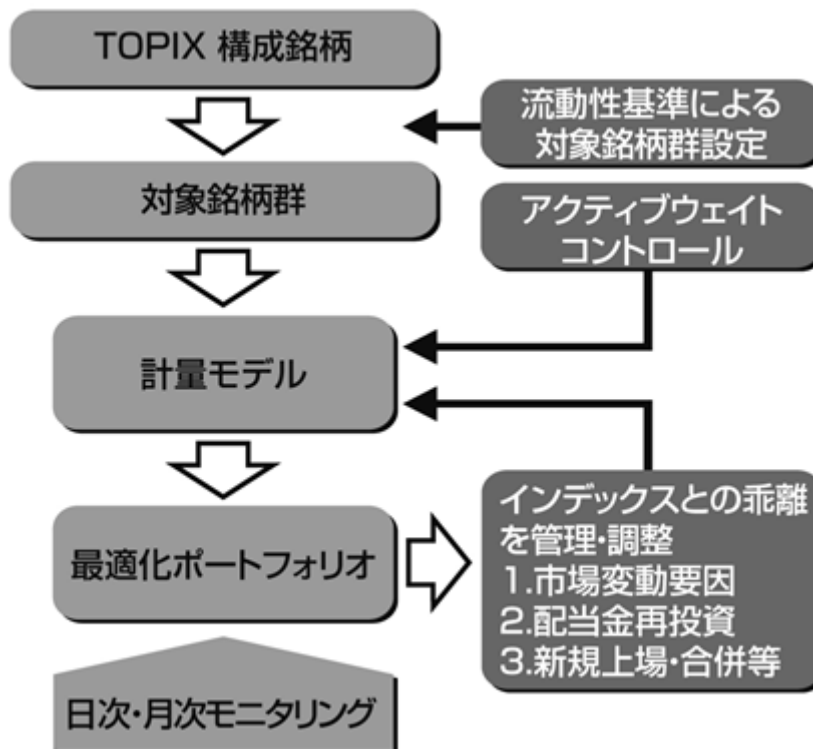
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.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。

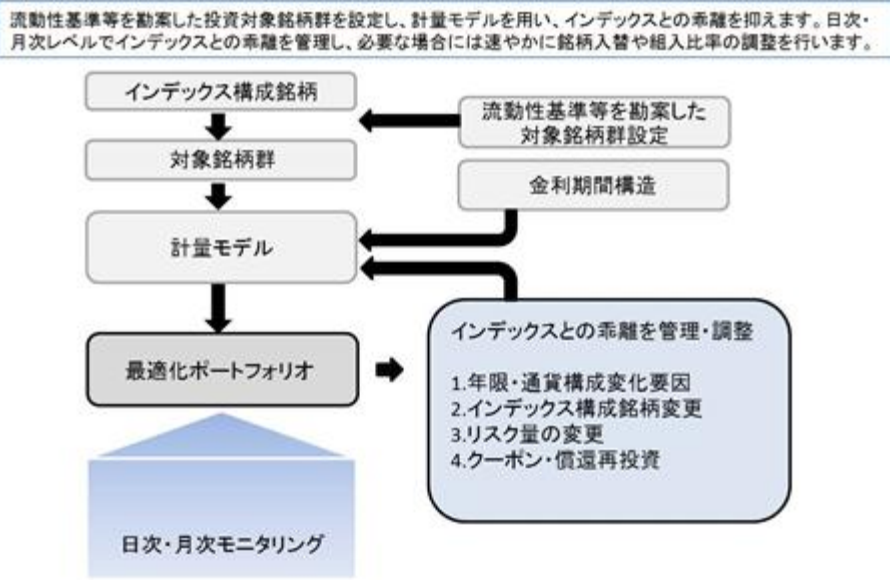
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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
- ・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
- ・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



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 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。 3. 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。 4. 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。
--------	--

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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的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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 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、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 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。 3. 外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>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>

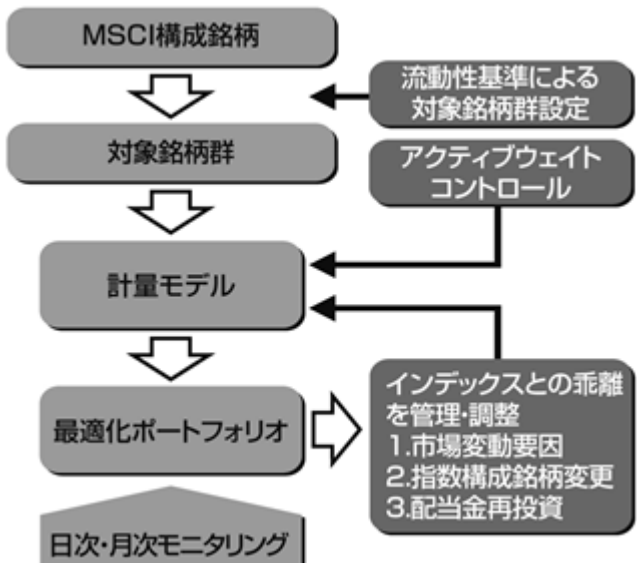
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> 
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 6. 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。 7. 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。 8. 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。

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	<ol style="list-style-type: none">1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.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。3.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。
------	--

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

	<p>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。</p>
運用プロセス	<p>1.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。</p> <p>2.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。</p> <p>3.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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[アクティブウェイトコントロール] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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。 3. 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、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 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。 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。 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。
--------	--

ファンド名	J - R E I T インデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証 R E I T 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す。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 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資等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度

1. 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す。
2. 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。
3. 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。

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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。

㈱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。

㈱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。

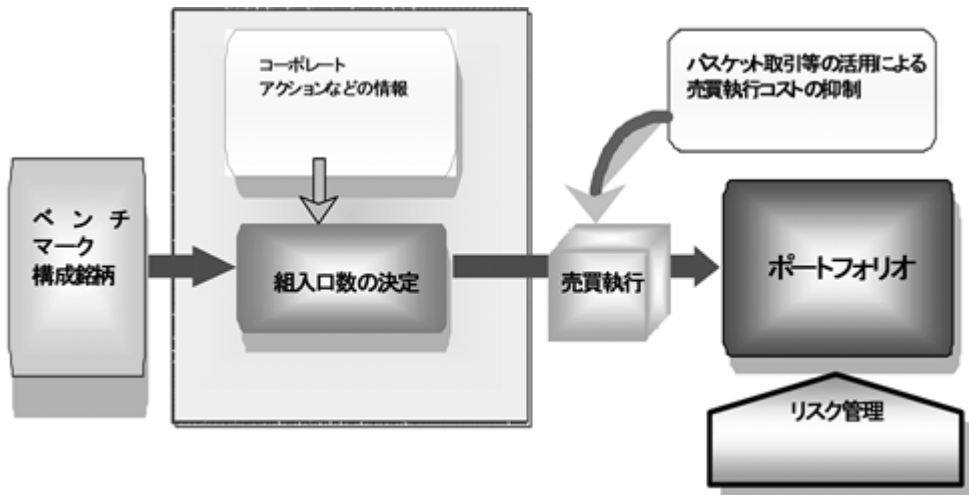
㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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、㈱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。

㈱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。

㈱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。

以上の項目に限らず、㈱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>運用プロセス</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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に取り得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・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>主な投資制限</p>	<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>

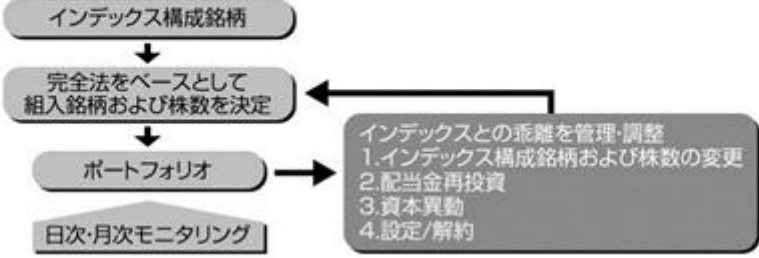
<p>ファンド名</p>	<p>外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
--------------	--------------------------------

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)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	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。 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とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none">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 & 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。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。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。
------	--

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 (「SPDJI」) 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、SPDJI、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

	<p>は責任も負わないものとしします。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S & 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&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します。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&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>
運用プロセス	<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&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] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] C --> 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 --> B </pre>

<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 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 & 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 & 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。 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。 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。 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。
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>エマージング債券パッシブ・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>新興国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4. 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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス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。</p> </div>

運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・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>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 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。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. 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。 5. 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。 6. 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。

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*) DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。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。
------	---

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。

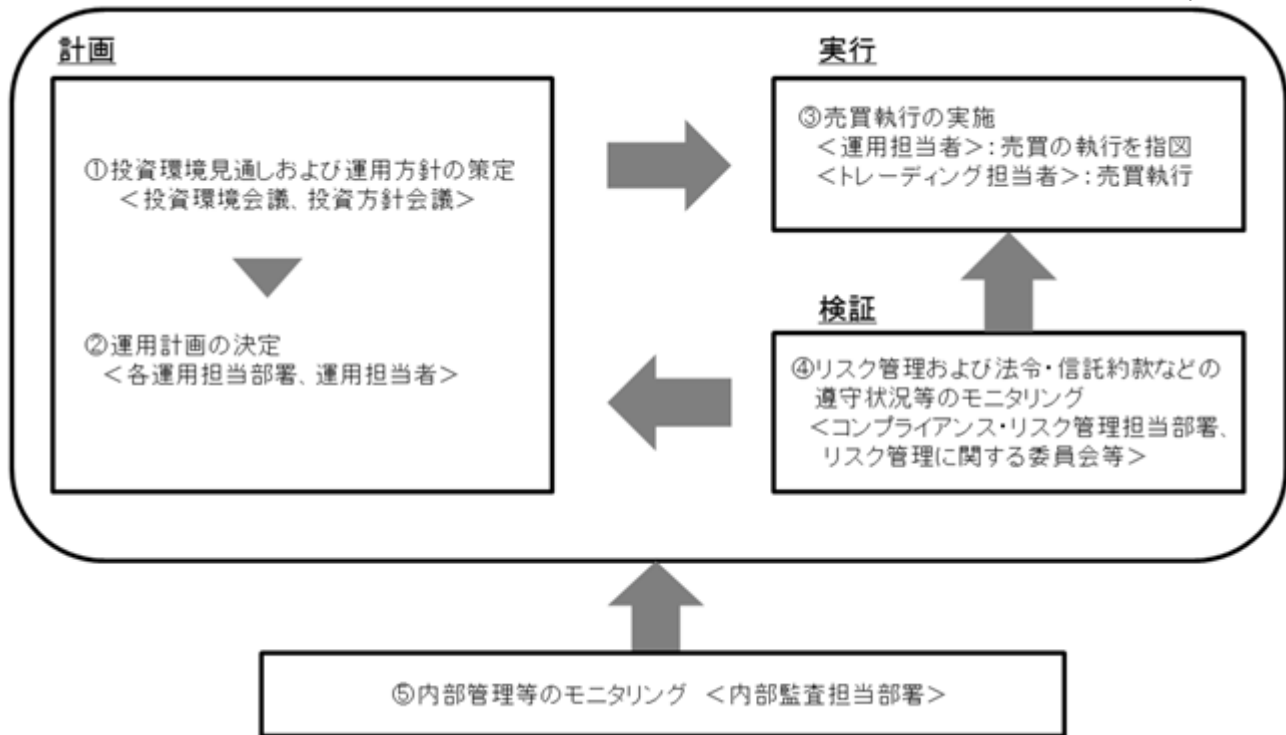
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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

	<p>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。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D F["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D G[日次・月次モニタリング] --> D </pre>
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. 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。 5. 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。 6. 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。

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。

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2020年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

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。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(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

(1) 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料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、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、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、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、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。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、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受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 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、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としません。)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。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

各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)

委託会社は、信託財産に属する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(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。以下同じ。))を除きます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。(約款第17条第3項)

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)

非株式割合(マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)について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)

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20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、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲(約款第21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、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- 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ません。)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(約款第22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、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における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金融商品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(約款第23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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行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基に算出した価額で評価するものとします。
- 4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行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または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第24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、合理的方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25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.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - 1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第26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。

外国為替予約取引の指図(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、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、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3)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33条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 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、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。

当ファンドは短期金融債等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行います。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない場合、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基準価額が下がる要因となります。

為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があります。その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受

ける可能性があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

信用リスク

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

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

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

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もあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

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、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、信託契約を解約することが受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、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。

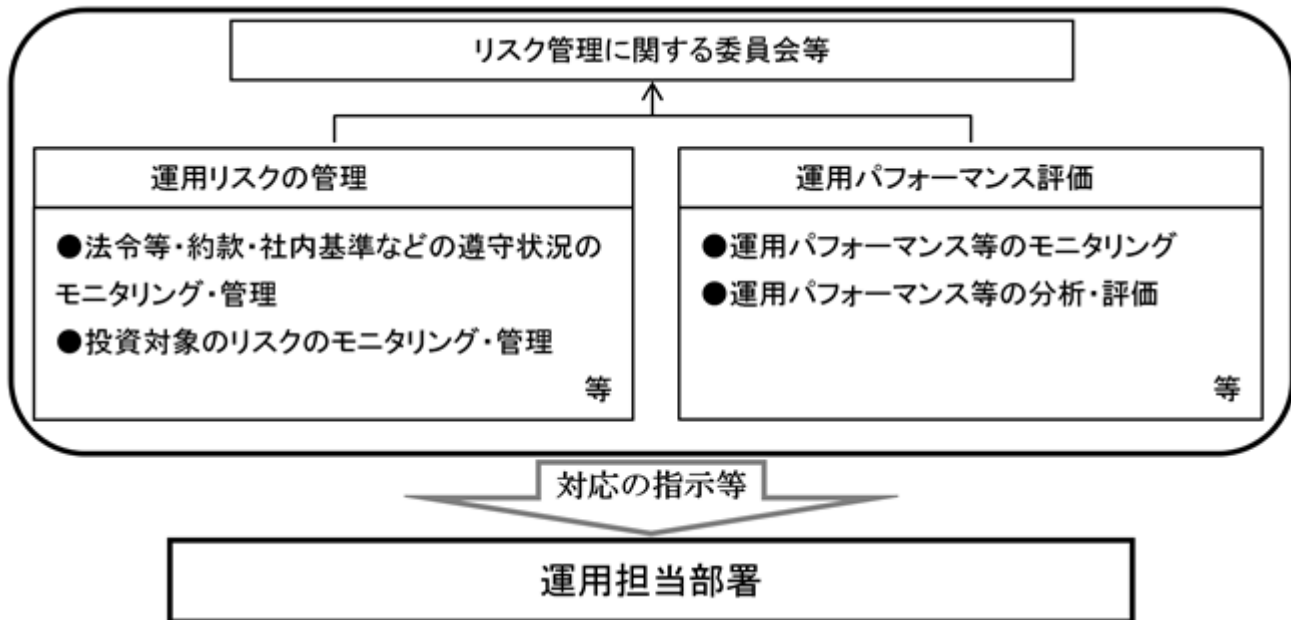
注意事項

- ・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(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。



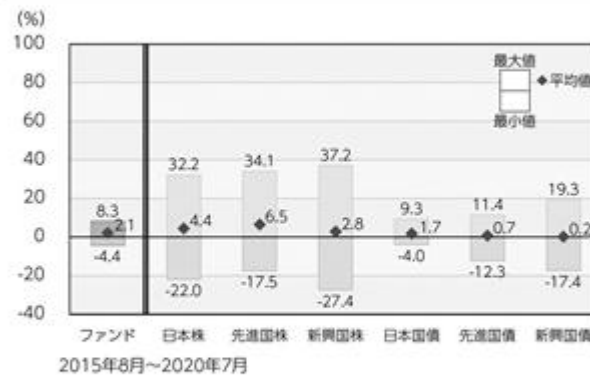
リスク管理体制は2020年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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



*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)	「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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「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。
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)	「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。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「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。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「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。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド」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。

(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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(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1.54%(税抜1.40%)

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.65%	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0.70%	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0.05%	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(ファンドの基準価額に反映)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（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）に対する投資顧問報酬（当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.2925%）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】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ 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(ファンドの基準価額に反映)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関する費用は、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。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2020年7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、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別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】

令和2年7月31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	209,466,656,557	85.79
内 日本	209,466,656,557	85.79
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	34,702,909,924	14.21
純資産総額	244,169,566,481	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)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	172,352,343,600	80.13
内 日本	172,352,343,600	80.13
地方債証券	16,817,730,000	7.82
内 日本	16,817,730,000	7.82
特殊債券	15,347,203,615	7.14
内 日本	15,347,203,615	7.14
社債券	9,586,247,150	4.46
内 日本	9,183,311,150	4.27
内 フランス	402,936,000	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	989,011,216	0.46
純資産総額	215,092,535,581	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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	206,304,233,240	98.22
内 日本	206,304,233,240	98.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,743,929,317	1.78
純資産総額	210,048,162,557	100.00

その他資産の投資状況

令和2年7月31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）	3,771,180,000	1.80
内 日本	3,771,180,000	1.80

(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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	382,820,034,828	99.38
内 アメリカ	169,704,209,760	44.06
内 フランス	39,844,112,135	10.34
内 イタリア	36,118,874,155	9.38
内 ドイツ	29,562,674,436	7.67
内 イギリス	25,509,002,160	6.62
内 スペイン	23,614,522,831	6.13
内 ベルギー	10,019,093,573	2.60
内 オーストラリア	8,476,967,395	2.20
内 オランダ	7,741,393,716	2.01
内 カナダ	7,054,255,676	1.83
内 オーストリア	6,027,742,314	1.56
内 アイルランド	3,135,950,180	0.81
内 メキシコ	2,759,167,458	0.72
内 フィンランド	2,383,898,357	0.62
内 ポーランド	2,310,936,908	0.60
内 デンマーク	1,982,419,379	0.51
内 マレーシア	1,749,692,723	0.45
内 シンガポール	1,594,238,141	0.41
内 イスラエル	1,365,074,516	0.35
内 スウェーデン	1,082,835,943	0.28
内 ノルウェー	782,973,072	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,384,204,563	0.62
純資産総額	385,204,239,391	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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	343,938,173,385	95.35
内 アメリカ	234,810,515,188	65.10
内 イギリス	15,696,427,335	4.35
内 スイス	13,357,961,278	3.70
内 カナダ	12,342,311,153	3.42
内 フランス	12,059,361,177	3.34
内 ドイツ	11,048,091,122	3.06
内 オーストラリア	7,658,736,110	2.12
内 オランダ	6,757,670,407	1.87
内 アイルランド	6,364,114,866	1.76
内 スウェーデン	3,658,505,340	1.01
内 デンマーク	2,964,316,403	0.82
内 香港	2,807,031,865	0.78
内 スペイン	2,804,017,490	0.78
内 イタリア	2,228,481,833	0.62
内 フィンランド	1,405,016,302	0.39
内 バミューダ	1,138,583,925	0.32

内	ベルギー	1,124,669,766	0.31
内	ジャージー	1,084,821,041	0.30
内	シンガポール	1,068,659,071	0.30
内	イスラエル	741,255,729	0.21
内	ケイマン諸島	681,030,419	0.19
内	ノルウェー	643,933,446	0.18
内	ニュージーランド	388,982,964	0.11
内	ルクセンブルグ	264,119,369	0.07
内	オランダ領キュラソー	223,951,896	0.06
内	オーストリア	201,190,286	0.06
内	ポルトガル	187,047,094	0.05
内	リベリア	74,053,923	0.02
内	パナマ	61,773,017	0.02
内	マン島	46,499,225	0.01
内	パプアニューギニア	45,044,345	0.01
新株予約権証券		7,016,672	0.00
内	アメリカ	7,016,672	0.00
投資信託受益証券		684,849,730	0.19
内	オーストラリア	463,807,527	0.13
内	シンガポール	221,042,203	0.06
投資証券		7,984,612,093	2.21
内	アメリカ	7,385,861,786	2.05
内	イギリス	190,982,055	0.05
内	香港	140,423,625	0.04
内	フランス	131,882,792	0.04
内	オランダ	70,661,647	0.02
内	カナダ	64,800,188	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,094,032,085	2.24
純資産総額		360,708,683,965	100.00

その他資産の投資状況

令和2年7月31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）	8,114,225,782	2.25	
内	アメリカ	5,929,845,912	1.64
内	ドイツ	1,335,271,375	0.37
内	イギリス	383,191,855	0.11
内	カナダ	273,274,689	0.08
内	オーストラリア	192,641,951	0.05

（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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	43,274,862,058	97.83
内 日本	43,274,862,058	97.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	960,893,101	2.17
純資産総額	44,235,755,159	100.00

その他資産の投資状況

令和2年7月31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）	866,434,000	1.96
内 日本	866,434,000	1.96

（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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31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	4,093,289,589	10.85
内 オーストラリア	2,446,741,817	6.48
内 シンガポール	1,646,547,772	4.36
投資証券	33,528,446,606	88.86
内 アメリカ	28,222,430,467	74.80
内 イギリス	1,974,305,584	5.23
内 カナダ	714,294,505	1.89
内 香港	621,215,173	1.65
内 フランス	561,688,544	1.49
内 ベルギー	475,393,383	1.26
内 オランダ	304,112,856	0.81
内 スペイン	179,466,606	0.48
内 ニュージーランド	176,463,611	0.47
内 ドイツ	102,936,357	0.27
内 ガーンジィ	80,903,759	0.21
内 アイルランド	54,918,763	0.15
内 イスラエル	24,092,787	0.06
内 韓国	19,461,149	0.05
内 マン島	11,326,985	0.03
内 イタリア	5,436,077	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	108,254,238	0.29
純資産総額	37,729,990,433	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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	112,251,118,399	97.35
内 メキシコ	17,916,218,009	15.54
内 インドネシア	15,405,369,361	13.36
内 ロシア	15,309,685,972	13.28
内 ブラジル	12,320,708,478	10.69
内 コロンビア	11,124,965,105	9.65
内 フィリピン	10,366,112,936	8.99
内 パナマ	6,474,354,599	5.62
内 南アフリカ	6,377,915,334	5.53
内 ペルー	5,030,965,864	4.36
内 ハンガリー	4,807,449,966	4.17
内 ルーマニア	4,397,638,930	3.81
内 クロアチア	2,719,733,845	2.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,053,325,969	2.65
純資産総額	115,304,444,368	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	35,546,849,249	86.35
内 ケイマン諸島	9,179,458,886	22.30
内 台湾	4,559,742,717	11.08
内 中国	4,322,595,410	10.50
内 韓国	4,143,773,489	10.07
内 インド	2,922,178,046	7.10
内 ブラジル	1,909,514,089	4.64
内 南アフリカ	1,301,037,984	3.16
内 ロシア	997,728,013	2.42
内 サウジアラビア	890,400,790	2.16
内 香港	860,182,392	2.09
内 タイ	714,890,277	1.74
内 マレーシア	617,935,361	1.50
内 インドネシア	508,044,708	1.23
内 メキシコ	450,497,199	1.09
内 パミュータ	312,762,951	0.76
内 カタール	280,966,633	0.68
内 フィリピン	268,211,866	0.65
内 ポーランド	244,548,310	0.59
内 チリ	205,439,273	0.50
内 アラブ首長国連邦	174,674,960	0.42
内 トルコ	134,465,209	0.33
内 アメリカ	124,374,770	0.30
内 ハンガリー	78,017,560	0.19
内 コロンビア	65,608,507	0.16
内 ルクセンブルグ	54,058,102	0.13

	内 ギリシャ	48,709,180	0.12
	内 チェコ	40,801,769	0.10
	内 ジャージー	32,282,160	0.08
	内 エジプト	30,350,338	0.07
	内 オランダ	26,983,636	0.07
	内 ベルギー	14,797,177	0.04
	内 マン島	13,697,190	0.03
	内 シンガポール	7,203,600	0.02
	内 アルゼンチン	6,462,870	0.02
	内 パキスタン	4,453,827	0.01
新株予約権証券		28,536	0.00
	内 タイ	28,536	0.00
投資信託受益証券		201,529,780	0.49
	内 メキシコ	125,683,055	0.31
	内 ブラジル	75,846,725	0.18
投資証券		32,913,994	0.08
	内 南アフリカ	19,066,072	0.05
	内 メキシコ	13,847,922	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,386,003,324	13.08
純資産総額		41,167,324,883	100.00

その他資産の投資状況

令和2年7月31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)	5,424,299,730	13.18
内 アメリカ	5,424,299,730	13.18

(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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年7月31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	為替フルヘッジ外国債券 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	90,958,811,116	1.4761 134,270,038,774	1.4871 135,264,848,010	- -	55.40
2	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	15,256,234,019	2.0439 31,183,578,815	2.0642 31,491,918,262	- -	12.90
3	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	7,978,590,646	1.3056 10,417,238,122	1.3104 10,455,145,182	- -	4.28
4	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	4,308,873,119	1.8839 8,117,770,747	1.8855 8,124,380,265	- -	3.33
5	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	3,222,653,220	2.5256 8,139,346,364	2.4020 7,740,813,034	- -	3.17
6	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,164,734,624	1.1498 7,088,828,344	1.1425 7,043,209,307	- -	2.88
7	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	4,314,351,960	1.0747 4,636,736,261	1.1008 4,749,238,637	- -	1.95
8	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	1,204,155,345	3.8152 4,594,119,959	3.8177 4,597,103,860	- -	1.88

(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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	85.79
合計	85.79

(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)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31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	2,200,000,000	101.69 2,237,308,000	101.61 2,235,530,000	0.1 2028/3/20	1.04
2	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,080,000,000	101.55 2,112,366,200	101.36 2,108,329,600	0.1 2026/6/20	0.98
3	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,010,000,000	101.79 2,046,005,500	101.47 2,039,727,900	0.1 2026/12/20	0.95
4	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	101.52 2,010,172,000	101.42 2,008,135,800	0.1 2026/9/20	0.93
5	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	101.47 2,009,145,600	101.30 2,005,799,400	0.1 2026/3/20	0.93
6	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,940,000,000	102.90 1,996,282,900	102.70 1,992,418,800	0.5 2024/9/20	0.93
7	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,940,000,000	103.08 1,999,933,500	102.60 1,990,478,800	0.4 2025/6/20	0.93
8	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,910,000,000	101.92 1,946,672,000	101.59 1,940,483,600	0.1 2027/6/20	0.90
9	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,860,000,000	103.01 1,916,019,000	102.58 1,908,043,800	0.6 2023/12/20	0.89
10	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,830,000,000	102.76 1,880,520,000	102.49 1,875,585,300	0.4 2025/3/20	0.87
11	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,770,000,000	103.18 1,826,392,200	102.76 1,818,887,400	0.8 2023/6/20	0.85
12	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,750,000,000	103.02 1,803,005,000	102.73 1,797,897,500	0.4 2025/9/20	0.84
13	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,770,000,000	101.63 1,798,869,000	101.53 1,797,204,900	0.1 2027/3/20	0.84
14	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,760,000,000	101.74 1,790,624,000	101.63 1,788,828,800	0.1 2027/12/20	0.83
15	130回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,780,000,000	100.46 1,788,188,000	100.35 1,786,265,600	0.1 2021/12/20	0.83

16	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,720,000,000	101.60 1,747,520,000	101.55 1,746,763,200	0.1 2028/9/20	0.81
17	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,680,000,000	101.70 1,708,572,000	101.61 1,707,199,200	0.1 2027/9/20	0.79
18	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,670,000,000	101.41 1,693,674,500	101.38 1,693,162,900	0.1 2029/3/20	0.79
19	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,610,000,000	102.58 1,651,580,000	102.33 1,647,513,000	0.3 2025/12/20	0.77
20	142回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,620,000,000	101.14 1,638,556,200	101.05 1,637,123,400	0.1 2024/12/20	0.76
21	328回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,590,000,000	102.28 1,626,261,600	101.99 1,621,656,900	0.6 2023/3/20	0.75
22	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,560,000,000	101.61 1,585,116,000	101.58 1,584,772,800	0.1 2028/6/20	0.74
23	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,540,000,000	101.37 1,561,098,000	101.47 1,562,715,000	0.1 2028/12/20	0.73
24	132回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,500,000,000	100.57 1,508,601,000	100.48 1,507,200,000	0.1 2022/6/20	0.70
25	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,450,000,000	100.98 1,464,268,000	100.88 1,462,803,500	0.1 2023/12/20	0.68
26	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,420,000,000	101.39 1,439,820,400	101.29 1,438,346,400	0.1 2029/6/20	0.67
27	131回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,420,000,000	100.52 1,427,412,400	100.41 1,425,907,200	0.1 2022/3/20	0.66
28	141回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,410,000,000	101.08 1,425,298,500	101.03 1,424,649,900	0.1 2024/9/20	0.66
29	140回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,390,000,000	101.04 1,404,483,100	100.97 1,403,552,500	0.1 2024/6/20	0.65
30	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,330,000,000	103.14 1,371,878,000	102.92 1,368,915,800	0.6 2024/6/20	0.64

（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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	80.13
地方債証券	7.82
特殊債証券	7.14
社債証券	4.46
合計	99.54

（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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31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	1,097,900	7,649.68 8,398,589,130	6,217.00 6,825,644,300	- -	3.25
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	766,200	4,907.02 3,759,765,800	6,595.00 5,053,089,000	- -	2.41
3	ソニー 日本	株式 電気機器	616,400	7,605.09 4,687,778,154	8,076.00 4,978,046,400	- -	2.37
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	89,200	37,843.85 3,375,671,686	44,220.00 3,944,424,000	- -	1.88
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,290,800	2,799.22 3,613,233,555	2,443.50 3,154,069,800	- -	1.50
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	818,700	4,318.95 3,535,927,565	3,756.00 3,075,037,200	- -	1.46
7	任天堂 日本	株式 その他製品	60,300	40,865.11 2,464,166,196	46,440.00 2,800,332,000	- -	1.33
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	6,639,200	553.41 3,674,259,182	393.20 2,610,533,440	- -	1.24
9	第一三共 日本	株式 医薬品	281,600	8,033.06 2,262,109,824	9,258.00 2,607,052,800	- -	1.24
10	ダイキン工業 日本	株式 機械	125,400	15,892.64 1,992,938,071	18,450.00 2,313,630,000	- -	1.10
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	704,000	3,365.43 2,369,269,010	3,259.00 2,294,336,000	- -	1.09

12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	673,700	4,228.99 2,849,074,280	3,268.00 2,201,651,600	- -	1.05
13	HOYA 日本	株式 精密機器	195,200	10,028.12 1,957,489,652	10,420.00 2,033,984,000	- -	0.97
14	信越化学工業 日本	株式 化学	165,500	13,196.29 2,183,986,166	12,275.00 2,031,512,500	- -	0.97
15	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	690,500	3,155.15 2,178,637,240	2,907.50 2,007,628,750	- -	0.96
16	日本電産 日本	株式 電気機器	236,900	7,137.36 1,690,842,592	8,375.00 1,984,037,500	- -	0.94
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	774,600	2,781.84 2,154,820,173	2,524.00 1,955,090,400	- -	0.93
18	村田製作所 日本	株式 電気機器	289,100	6,443.75 1,862,890,585	6,609.00 1,910,661,900	- -	0.91
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	671,200	3,760.62 2,524,130,129	2,800.00 1,879,360,000	- -	0.89
20	花王 日本	株式 化学	235,600	8,670.53 2,042,777,553	7,636.00 1,799,041,600	- -	0.86
21	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	62,400	23,881.16 1,490,184,532	28,800.00 1,797,120,000	- -	0.86
22	SMC 日本	株式 機械	30,800	50,129.01 1,543,973,642	55,070.00 1,696,156,000	- -	0.81
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	13,186,500	158.35 2,088,187,078	127.60 1,682,597,400	- -	0.80
24	ファナック 日本	株式 電気機器	92,500	19,914.26 1,842,069,746	17,705.00 1,637,712,500	- -	0.78
25	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	677,900	2,606.54 1,766,975,906	2,300.00 1,559,170,000	- -	0.74
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	343,200	6,014.09 2,064,037,219	4,436.00 1,522,435,200	- -	0.72
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	472,800	4,074.41 1,926,384,141	3,128.00 1,478,918,400	- -	0.70
28	中外製薬 日本	株式 医薬品	307,800	4,128.76 1,270,833,911	4,736.00 1,457,740,800	- -	0.69
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	853,100	1,935.01 1,650,765,076	1,650.00 1,407,615,000	- -	0.67
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	983,800	1,578.63 1,553,058,091	1,370.50 1,348,297,900	- -	0.64

(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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	98.22
合計	98.22

（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

令和2年7月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	15.48
情報・通信業		10.62
化学		7.12
輸送用機器		6.91
医薬品		6.72
機械		5.28
サービス業		5.16
小売業		4.98
銀行業		4.74
卸売業		4.42
食料品		3.81
陸運業		3.48
精密機器		2.61
その他製品		2.47
建設業		2.44
不動産業		1.85
保険業		1.82
電気・ガス業		1.44
その他金融業		1.07
証券、商品先物取引業		0.81
ガラス・土石製品		0.73
非鉄金属		0.68
ゴム製品		0.54
金属製品		0.53
鉄鋼		0.53
繊維製品		0.47
石油・石炭製品		0.41
空運業		0.31
パルプ・紙		0.22
倉庫・運輸関連業		0.18
鉱業		0.17
海運業		0.13
水産・農林業		0.09
合計	98.22	

（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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31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 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証 券	2,184,048,000	101.67 2,220,647,861	101.60 2,219,026,882	1.5 2021/9/30	0.58
2	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証 券	2,092,000,000	104.45 2,185,159,375	104.52 2,186,630,302	1.75 2023/5/15	0.57
3	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	2,092,000,000	103.39 2,163,013,588	103.42 2,163,667,338	1.625 2022/11/15	0.56
4	FRANCE OAT 3.0 04/25/22 フランス	国債証 券	1,629,826,900	106.65 1,738,366,852	106.35 1,733,356,764	3 2022/4/25	0.45
5	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証 券	1,591,346,600	105.54 1,679,532,663	106.12 1,688,738,603	0.5 2026/5/25	0.44
6	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証 券	1,521,930,000	107.99 1,643,561,625	109.13 1,660,925,003	1.5 2030/2/15	0.43
7	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	1,391,180,000	117.71 1,637,571,013	118.64 1,650,613,325	2.875 2028/5/15	0.43
8	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証 券	1,476,952,000	108.63 1,604,454,489	108.80 1,606,993,000	2.375 2024/8/15	0.42
9	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証 券	1,364,188,700	116.33 1,587,076,670	116.01 1,582,638,964	4.25 2023/10/25	0.41
10	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証 券	1,467,538,000	106.92 1,569,233,787	107.56 1,578,520,561	1.625 2026/5/15	0.41
11	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	1,448,710,000	108.50 1,571,963,523	108.72 1,575,132,575	2.25 2024/11/15	0.41
12	US T N/B 2.5 01/15/22 アメリカ	国債証 券	1,497,872,000	103.58 1,551,526,238	103.41 1,548,951,770	2.5 2022/1/15	0.40
13	US T N/B 1.75 11/15/29 アメリカ	国債証 券	1,384,904,000	110.00 1,523,502,586	111.33 1,541,895,841	1.75 2029/11/15	0.40
14	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	1,394,318,000	108.46 1,512,290,366	108.53 1,513,379,678	2.75 2023/11/15	0.39
15	US T N/B 0.375 03/31/22 アメリカ	国債証 券	1,492,642,000	100.33 1,497,656,232	100.41 1,498,851,539	0.375 2022/3/31	0.39
16	US T N/B 2.25 08/15/49 アメリカ	国債証 券	1,185,118,000	119.92 1,421,282,183	126.12 1,494,730,077	2.25 2049/8/15	0.39
17	US T N/B 3.0 02/15/49 アメリカ	国債証 券	1,028,218,000	137.84 1,417,395,537	144.38 1,484,570,060	3 2049/2/15	0.39
18	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	1,412,100,000	104.82 1,480,167,625	104.82 1,480,167,625	2.125 2022/12/31	0.38
19	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	1,356,662,000	108.66 1,474,204,036	108.82 1,476,323,820	2.5 2024/5/15	0.38
20	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証 券	1,254,954,300	112.91 1,416,971,410	115.97 1,455,396,855	2.8 2028/12/1	0.38
21	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	774,571,200	183.25 1,419,401,724	187.25 1,450,455,832	4.5 2041/4/25	0.38
22	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証 券	1,344,110,000	106.82 1,435,782,494	107.34 1,442,818,077	1.625 2026/2/15	0.37

23	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,261,476,000	112.30 1,416,696,672	113.20 1,428,030,252	2.25 2027/11/15	0.37
24	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	1,154,409,000	122.99 1,419,916,292	123.60 1,426,888,773	2.75 2027/10/25	0.37
25	US T N/B 2.875 10/15/21 アメリカ	国債証券	1,370,260,000	103.50 1,418,272,621	103.27 1,415,168,119	2.875 2021/10/15	0.37
26	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	923,527,200	151.24 1,396,832,119	152.10 1,404,696,877	5.5 2029/4/25	0.36
27	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,247,878,000	109.07 1,361,161,923	109.11 1,361,649,369	2.75 2024/2/15	0.35
28	US T N/B 1.625 04/30/23 アメリカ	国債証券	1,307,500,000	104.00 1,359,891,525	104.10 1,361,230,077	1.625 2023/4/30	0.35
29	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,203,946,000	110.10 1,325,599,942	110.39 1,329,137,564	2.25 2025/11/15	0.35
30	ITALY BTPS 5.0 03/01/25 イタリア	国債証券	1,086,137,500	119.83 1,301,522,693	120.90 1,313,194,544	5 2025/3/1	0.34

（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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.38
合計	99.38

（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

令和2年7月31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	365,047	33,308.57 12,159,197,124	40,245.89 14,691,643,597	- -	4.07
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	602,715	19,137.14 11,534,245,629	21,327.93 12,854,669,357	- -	3.56
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	35,300	222,974.88 7,871,013,577	319,226.64 11,268,700,674	- -	3.12

4	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	200,842	21,914.80 4,401,413,824	24,528.69 4,926,393,165	- -	1.37
5	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	25,555	155,421.76 3,971,803,183	160,189.66 4,093,647,016	- -	1.13
6	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	25,023	154,960.53 3,877,577,350	160,913.50 4,026,538,560	- -	1.12
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	219,890	15,536.66 3,416,357,100	15,359.46 3,377,392,538	- -	0.94
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	248,407	12,299.59 3,055,306,215	12,655.08 3,143,612,842	- -	0.87
9	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	142,391	21,492.25 3,060,303,947	20,298.67 2,890,348,774	- -	0.80
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	205,989	13,064.38 2,691,119,194	13,746.53 2,831,634,380	- -	0.79
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	256,480	13,863.76 3,555,779,287	10,148.29 2,602,833,932	- -	0.72
12	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	91,083	25,102.36 2,286,399,012	27,856.02 2,537,210,416	- -	0.70
13	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	79,271	30,694.76 2,433,204,985	31,927.05 2,530,889,814	- -	0.70
14	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	74,706	34,687.99 2,591,401,460	32,321.39 2,414,602,508	- -	0.67
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	115,682	23,013.65 2,662,265,576	20,323.77 2,351,095,517	- -	0.65

16	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	51,124	30,521.21 1,560,366,484	44,408.97 2,270,364,489	- -	0.63
17	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	58,663	38,852.94 2,279,230,050	37,008.53 2,171,031,894	- -	0.60
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	345,153	6,081.73 2,099,130,000	5,993.57 2,068,702,117	- -	0.57
19	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	12,321	81,600.23 1,005,396,456	155,591.45 1,917,042,304	- -	0.53
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	93,015	12,668.83 1,178,391,966	20,136.54 1,873,000,826	- -	0.52
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	462,143	3,790.44 1,751,729,357	4,052.20 1,872,697,713	- -	0.52
22	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	36,626	39,874.00 1,460,425,368	50,814.67 1,861,138,469	- -	0.52
23	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	600,323	3,906.43 2,345,123,022	3,093.02 1,856,812,246	- -	0.51
24	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	40,249	39,086.87 1,573,207,509	45,906.84 1,847,704,725	- -	0.51
25	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	150,803	14,132.23 2,131,183,483	12,098.03 1,824,420,122	- -	0.51
26	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	358,015	6,919.97 2,477,454,084	5,019.75 1,797,147,228	- -	0.50
27	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	211,914	8,592.57 1,820,887,251	8,262.35 1,750,908,485	- -	0.49
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	379,157	4,704.59 1,783,781,609	4,567.88 1,731,944,435	- -	0.48
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	354,318	4,844.88 1,716,630,342	4,857.62 1,721,143,620	- -	0.48
30	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	655,488	3,500.54 2,294,564,049	2,598.26 1,703,130,872	- -	0.47

(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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.35
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.19
投資証券	2.21
合計	97.76

（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。

投資株式の業種別投資比率

令和2年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	7.18
医薬品		5.45
銀行		5.17
情報技術サービス		4.71
コンピュータ・周辺機器		4.31
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.92
インターネット販売・通信販売		3.83
半導体・半導体製造装置		3.78
ヘルスケア機器・用品		3.18
保険		3.08
石油・ガス・消耗燃料		2.98
資本市場		2.95
化学		2.20
バイオテクノロジー		2.16
電力		2.08
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.03
食品		1.99
飲料		1.81
各種電気通信サービス		1.78
専門小売り		1.73
機械		1.60
金属・鉱業		1.57
食品・生活必需品小売り		1.51
家庭用品		1.48
娯楽		1.46
航空宇宙・防衛		1.45
ホテル・レストラン・レジャー		1.40
繊維・アパレル・贅沢品		1.31
メディア		1.11
コングロマリット		1.09
自動車		1.06
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.03
陸運・鉄道		1.03
総合公益事業		1.01
各種金融サービス		0.87
専門サービス		0.76
通信機器		0.75

電気設備	0.75
タバコ	0.75
パーソナル用品	0.72
航空貨物・物流サービス	0.60
建設関連製品	0.53
電子装置・機器・部品	0.52
複合小売り	0.48
不動産管理・開発	0.44
商業サービス・用品	0.43
家庭用耐久財	0.36
消費者金融	0.32
無線通信サービス	0.29
商社・流通業	0.29
建設・土木	0.26
容器・包装	0.25
建設資材	0.25
自動車部品	0.22
ヘルスケア・テクノロジー	0.17
ガス	0.17
運送インフラ	0.15
エネルギー設備・サービス	0.13
水道	0.13
紙製品・林産品	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
海運業	0.06
販売	0.05
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.02
合計	95.35

(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。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31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	4,837	672,192.76 3,251,396,413	592,000.00 2,863,504,000	- -	6.47
2	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	7,557	294,792.34 2,227,745,722	364,500.00 2,754,526,500	- -	6.23
3	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,994	589,834.37 2,945,632,881	540,000.00 2,696,760,000	- -	6.10
4	G L P 投資法人 日本	投資証券	14,361	145,798.60 2,093,813,827	175,700.00 2,523,227,700	- -	5.70
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	16,151	145,379.28 2,348,020,813	130,800.00 2,112,550,800	- -	4.78
6	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	7,126	264,998.60 1,888,380,076	274,700.00 1,957,512,200	- -	4.43

7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	4,744	315,939.05 1,498,814,900	341,000.00 1,617,704,000	- -	3.66
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	9,951	166,665.07 1,658,484,127	135,900.00 1,352,340,900	- -	3.06
9	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	6,440	162,857.05 1,048,799,433	197,400.00 1,271,256,000	- -	2.87
10	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	9,439	159,682.37 1,507,241,924	126,900.00 1,197,809,100	- -	2.71
11	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,660	625,627.87 1,038,542,265	681,000.00 1,130,460,000	- -	2.56
12	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	10,681	129,499.32 1,383,182,303	102,900.00 1,099,074,900	- -	2.48
13	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	3,263	276,183.11 901,185,507	317,000.00 1,034,371,000	- -	2.34
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	14,690	72,143.41 1,059,786,792	69,100.00 1,015,079,000	- -	2.29
15	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	4,669	158,606.85 740,535,416	192,700.00 899,716,300	- -	2.03
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,545	627,336.33 969,234,631	578,000.00 893,010,000	- -	2.02
17	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	2,503	409,176.06 1,024,167,699	348,500.00 872,295,500	- -	1.97
18	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	3,110	360,615.30 1,121,513,608	278,300.00 865,513,000	- -	1.96
19	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	1,431	452,712.96 647,832,258	577,000.00 825,687,000	- -	1.87
20	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	5,746	145,195.07 834,290,876	137,100.00 787,776,600	- -	1.78
21	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	2,179	310,692.25 676,998,425	331,000.00 721,249,000	- -	1.63
22	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	6,301	95,689.97 602,942,504	107,000.00 674,207,000	- -	1.52
23	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	3,258	179,564.16 585,020,041	193,300.00 629,771,400	- -	1.42
24	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	16,089	51,296.95 825,316,768	38,150.00 613,795,350	- -	1.39
25	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,064	634,573.50 675,186,211	553,000.00 588,392,000	- -	1.33

26	プレミア投資法人 日本	投資証券	4,511	122,504.62 552,618,374	118,700.00 535,455,700	- -	1.21
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	5,066	119,976.61 607,801,534	104,000.00 526,864,000	- -	1.19
28	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,622	384,945.73 624,381,980	319,500.00 518,229,000	- -	1.17
29	ジャパンエクセレント投資 法人 日本	投資証券	4,634	139,050.51 644,360,085	111,800.00 518,081,200	- -	1.17
30	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	20,884	32,001.98 668,329,401	24,200.00 505,392,800	- -	1.14

(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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.83
合計	97.83

(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

令和2年7月31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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	236,390	9,657.07 2,282,837,021	11,002.87 2,600,969,384	- -	6.89
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	28,332	74,502.51 2,110,805,173	81,373.56 2,305,475,985	- -	6.11
3	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	85,902	14,721.74 1,264,627,655	16,603.15 1,426,244,478	- -	3.78
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	48,140	19,972.46 961,474,394	20,680.46 995,557,633	- -	2.64
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	133,735	5,338.59 713,957,187	5,702.79 762,662,888	- -	2.02
6	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	40,426	17,352.87 701,507,373	18,423.19 744,776,202	- -	1.97
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	45,085	16,210.78 730,863,410	15,815.51 713,042,719	- -	1.89
8	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	110,022	6,409.43 705,178,387	6,333.52 696,827,637	- -	1.85
9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	518,382	1,152.76 597,574,938	1,282.04 664,588,377	- -	1.76
10	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	97,591	6,997.55 682,898,840	6,654.65 649,434,143	- -	1.72

11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	111,902	6,212.56 695,198,875	5,643.16 631,482,009	- -	1.67
12	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	174,020	2,912.63 506,856,066	3,119.17 542,798,311	- -	1.44
13	LINK REIT 香港	投資証 券	658,520	883.17 581,590,648	814.05 536,068,206	- -	1.42
14	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	172,279	2,764.89 476,332,651	2,905.78 500,606,250	- -	1.33
15	SEGRO PLC イギリス	投資証 券	381,758	1,216.31 464,339,862	1,305.69 498,457,739	- -	1.32
16	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証 券	117,911	3,729.38 439,735,614	4,180.86 492,969,619	- -	1.31
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	31,453	14,861.30 467,432,558	15,448.37 485,897,707	- -	1.29
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	20,938	24,377.44 510,414,850	23,076.85 483,183,127	- -	1.28
19	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	119,420	3,748.49 447,644,966	4,030.23 481,291,021	- -	1.28
20	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	36,607	11,980.83 438,582,377	12,292.59 449,994,915	- -	1.19
21	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	41,327	9,755.24 403,155,146	10,617.94 438,807,854	- -	1.16
22	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	46,254	9,489.11 438,909,452	9,233.04 427,065,124	- -	1.13
23	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	58,318	6,723.37 392,093,682	7,064.68 411,998,241	- -	1.09
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	55,204	7,195.73 397,233,461	7,377.43 407,264,087	- -	1.08
25	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証 券	169,480	2,008.23 340,354,944	2,152.66 364,834,172	- -	0.97
26	UDR INC アメリカ	投資証 券	94,603	3,940.42 372,776,262	3,776.05 357,226,604	- -	0.95
27	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	150,352	2,329.47 350,241,871	2,265.63 340,642,903	- -	0.90
28	CYRUSONE INC アメリカ	投資証 券	36,969	8,021.82 296,559,001	8,699.58 321,614,846	- -	0.85
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	30,868	9,750.16 300,967,981	9,724.66 300,180,866	- -	0.80
30	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	91,281	2,749.92 251,015,549	2,954.94 269,730,790	- -	0.71

(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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.85
投資証券	88.86
合計	99.71

(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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31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	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,405,800,000	125.38 3,016,432,624	136.02 3,272,585,682	5.25 2047/6/23	2.84
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	1,569,000,000	119.40 1,873,486,416	124.65 1,955,786,742	5.1 2035/3/28	1.70
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,610,840,000	96.46 1,553,902,454	112.37 1,810,253,937	4.75 2044/3/8	1.57
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,464,400,000	103.40 1,514,241,900	122.32 1,791,393,198	5 2045/6/15	1.55
5	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,046,000,000	146.39 1,531,239,400	169.92 1,777,462,570	5.625 2050/11/18	1.54
6	INDONESIA 6.75 01/15/44 インドネシア	国債証券	993,700,000	137.23 1,363,739,759	154.49 1,535,258,490	6.75 2044/1/15	1.33
7	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,297,040,000	112.09 1,453,857,052	116.18 1,506,907,557	6 2024/1/26	1.31
8	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,297,040,000	111.52 1,446,557,332	114.66 1,487,218,490	4.375 2029/3/21	1.29
9	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,297,040,000	109.52 1,420,644,774	111.17 1,442,016,646	4.875 2023/9/16	1.25
10	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,046,000,000	127.73 1,336,129,020	136.10 1,423,680,266	5.625 2042/4/4	1.23
11	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,255,200,000	103.10 1,294,112,246	112.08 1,406,922,300	4.5 2029/4/22	1.22
12	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,192,440,000	110.74 1,320,560,983	115.62 1,378,712,244	4.75 2026/5/27	1.20
13	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,265,660,000	104.67 1,324,824,375	107.50 1,360,679,424	4.25 2025/1/7	1.18
14	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,035,540,000	113.16 1,171,890,388	128.92 1,335,116,544	6.05 2040/1/11	1.16
15	BRAZIL 6.0 04/07/26 ブラジル	国債証券	1,129,680,000	112.18 1,267,291,760	117.13 1,323,278,910	6 2026/4/7	1.15
16	HUNGARY 5.375 02/21/23 ハンガリー	国債証券	1,188,046,800	108.74 1,291,893,500	110.75 1,315,880,635	5.375 2023/2/21	1.14
17	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	732,200,000	163.75 1,199,030,636	174.58 1,278,277,688	7.625 2041/3/29	1.11

18	COLOMBIA 7.375 09/18/37 コロンビア	国債証券	878,640,000	127.71 1,122,148,800	145.25 1,276,224,600	7.375 2037/9/18	1.11
19	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	941,400,000	117.33 1,104,576,000	133.15 1,253,474,100	6.125 2041/1/18	1.09
20	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,108,760,000	102.61 1,137,734,200	113.02 1,253,225,884	5.625 2047/2/21	1.09
21	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	826,340,000	127.00 1,049,485,272	151.10 1,248,599,740	6.7 2036/1/26	1.08
22	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,129,680,000	104.14 1,176,475,948	108.81 1,229,312,127	4.625 2028/1/13	1.07
23	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	983,240,000	109.31 1,074,789,476	125.00 1,229,050,000	5.55 2045/1/21	1.07
24	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,087,840,000	108.57 1,181,112,656	112.78 1,226,955,154	4.25 2027/6/23	1.06
25	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,025,080,000	98.48 1,009,599,200	119.40 1,223,991,648	5.75 2110/10/12	1.06
26	CROATIA 5.5 04/04/23 クロアチア	国債証券	1,087,840,000	108.54 1,180,795,091	111.48 1,212,826,288	5.5 2023/4/4	1.05
27	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	711,280,000	159.68 1,135,817,386	168.39 1,197,752,025	9.5 2030/2/2	1.04
28	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,087,840,000	101.43 1,103,425,400	110.08 1,197,575,860	4.15 2027/3/28	1.04
29	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,030,623,800	113.01 1,164,811,018	115.90 1,194,513,596	7.5 2030/3/31	1.04
30	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 メキシコ	国債証券	857,720,000	124.40 1,067,060,164	135.88 1,165,469,936	6.75 2034/9/27	1.01

(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

令和2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.35
合計	97.35

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31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	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	101,997	22,004.69 2,244,412,410	26,436.60 2,696,454,298	- -	6.55
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	311,700	5,712.33 1,780,533,986	7,222.50 2,251,253,250	- -	5.47
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,336,083	1,093.72 1,461,313,753	1,545.03 2,064,301,678	- -	5.01
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	259,953	4,519.04 1,174,739,244	5,192.00 1,349,675,976	- -	3.28
5	MEITUAN DIANPING ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	193,800	1,853.46 359,201,848	2,632.50 510,178,500	- -	1.24
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	24,174	17,972.83 434,475,202	19,507.87 471,583,370	- -	1.15
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	155,439	1,716.28 266,777,150	2,973.47 462,194,524	- -	1.12
8	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,180,530	83.60 433,107,753	77.89 403,537,384	- -	0.98
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	318,500	1,068.28 340,248,678	1,115.77 355,374,337	- -	0.86
10	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	46,345	5,336.31 247,311,715	6,515.53 301,962,423	- -	0.73
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	186,657	922.03 172,104,513	1,355.64 253,040,535	- -	0.61

12	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	200,921	967.65 194,421,273	1,242.55 249,655,513	- -	0.61
13	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	335,500	786.10 263,739,827	716.85 240,503,175	- -	0.58
14	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	90,553	2,400.34 217,358,787	2,553.01 231,183,303	- -	0.56
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	29,991	7,399.27 221,911,702	7,506.39 225,124,442	- -	0.55
16	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	4,496	39,112.17 175,848,317	47,197.61 212,200,463	- -	0.52
17	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	3,236,235	69.17 223,859,139	62.77 203,154,652	- -	0.49
18	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	82,507	1,496.72 123,490,540	2,431.47 200,614,120	- -	0.49
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	43,916	3,902.45 171,380,346	4,452.79 195,549,164	- -	0.48
20	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	681,225	274.87 187,251,895	277.68 189,162,558	- -	0.46
21	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	15,168	11,354.66 172,227,540	12,342.79 187,215,590	- -	0.45
22	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	150,108	1,137.16 170,697,925	1,232.71 185,039,782	- -	0.45
23	NAVER CORP 韓国	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	6,822	18,004.21 122,824,772	25,872.00 176,498,784	- -	0.43

24	TAL EDUCATION GROUP-ADR ケイマン諸島	株式 各種消費者サービス	21,099	5,774.46 121,835,347	8,158.79 172,142,521	- -	0.42
25	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	23,117	7,101.64 164,168,794	7,215.30 166,796,275	- -	0.41
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	324,951	544.92 177,073,237	511.91 166,346,445	- -	0.40
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	49,238	2,629.43 129,468,117	3,214.09 158,255,609	- -	0.38
28	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	269,347	480.29 129,364,956	563.98 151,908,152	- -	0.37
29	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO ブラジル	株式 資本市場	114,016	891.05 101,594,416	1,310.29 149,394,115	- -	0.36
30	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	4,188,200	39.73 166,435,638	35.37 148,136,634	- -	0.36

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	86.35
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.49
投資証券	0.08
合計	86.92

（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

令和2年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
銀行	外国	10.48
インターネット販売・通信販売		10.42
半導体・半導体製造装置		7.09
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.90
石油・ガス・消耗燃料		4.95
コンピュータ・周辺機器		4.78
金属・鉱業		3.01
保険		2.82
電子装置・機器・部品		2.08
不動産管理・開発		2.04
無線通信サービス		1.97
化学		1.94
食品		1.77
自動車		1.52
情報技術サービス		1.47
医薬品		1.36
食品・生活必需品小売り		1.25
資本市場		1.20
娯楽		1.12
各種電気通信サービス		1.11
飲料		1.01
各種消費者サービス		0.88
コングロマリット		0.87
建設資材		0.83
電力		0.67
バイオテクノロジー		0.63
繊維・アパレル・贅沢品		0.63
パーソナル用品		0.59
貯蓄・抵当・不動産金融		0.58
ホテル・レストラン・レジャー		0.58
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.56
運送インフラ		0.54
建設・土木		0.53
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.51
ガス		0.50
機械		0.49
専門小売り		0.48

各種金融サービス	0.48
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.46
家庭用品	0.46
複合小売り	0.44
ヘルスケア機器・用品	0.40
電気設備	0.38
自動車部品	0.36
ソフトウェア	0.34
家庭用耐久財	0.29
タバコ	0.27
航空貨物・物流サービス	0.26
商業サービス・用品	0.24
ヘルスケア・テクノロジー	0.24
陸運・鉄道	0.22
通信機器	0.18
水道	0.17
紙製品・林産品	0.16
消費者金融	0.15
メディア	0.14
航空宇宙・防衛	0.12
旅客航空輸送業	0.11
レジャー用品	0.08
海運業	0.07
エネルギー設備・サービス	0.07
総合公益事業	0.04
商社・流通業	0.04
専門サービス	0.03
建設関連製品	0.02
容器・包装	0.01
合計	86.35

（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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・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
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
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31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 0209月	買建	252	3,940,868,160	3,771,180,000	1.80

（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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31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	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Sep20	買建	349	5,701,499,144	5,929,845,912	1.64
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep20	買建	337	1,355,228,375	1,335,271,375	0.37
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep20	買建	47	395,656,697	383,191,855	0.11
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep20	買建	18	262,324,917	273,274,689	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Sep20	買建	17	190,422,305	192,641,951	0.05

(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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31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	T R E I T 先物 0 2 0 9 月	買建	524	905,058,040	866,434,000	1.96

(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。

外国リート・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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31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	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Sep20	買建	963	5,144,703,930	5,424,299,730	13.18

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(令和2年7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1特定期間末 (平成25年1月11日)	50	50	1.0170	1.0170
第2特定期間末 (平成25年7月11日)	51	51	1.0312	1.0312
第4計算期間末 (平成26年1月14日)	880	880	1.0440	1.0440
第5計算期間末 (平成26年7月11日)	4,155	4,155	1.0597	1.0597
第6計算期間末 (平成27年1月13日)	11,244	11,273	1.1340	1.1370
第7計算期間末 (平成27年7月13日)	28,752	28,830	1.1117	1.1147
第8計算期間末 (平成28年1月12日)	31,162	31,249	1.0760	1.0790
第9計算期間末 (平成28年7月11日)	31,925	32,011	1.1223	1.1253
第10計算期間末 (平成29年1月11日)	38,014	38,115	1.1200	1.1230
第11計算期間末 (平成29年7月11日)	59,334	59,493	1.1175	1.1205
第12計算期間末 (平成30年1月11日)	86,417	86,642	1.1513	1.1543
第13計算期間末 (平成30年7月11日)	103,558	103,832	1.1324	1.1354
第14計算期間末 (平成31年1月11日)	113,879	114,185	1.1159	1.1189
第15計算期間末 (令和1年7月11日)	128,732	129,059	1.1819	1.1849
第16計算期間末 (令和2年1月14日)	177,243	177,685	1.2017	1.2047
第17計算期間末 (令和2年7月13日)	227,606	229,097	1.2217	1.2297
令和1年7月末日	132,358	-	1.1847	-
8月末日	138,435	-	1.1965	-
9月末日	146,405	-	1.2018	-
10月末日	152,737	-	1.1980	-
11月末日	161,723	-	1.2011	-
12月末日	172,400	-	1.1996	-
令和2年1月末日	183,675	-	1.2075	-
2月末日	188,662	-	1.1992	-
3月末日	193,490	-	1.2008	-
4月末日	197,321	-	1.2087	-

5月末日	204,414	-	1.2229	-
6月末日	221,296	-	1.2273	-
7月末日	244,169	-	1.2239	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0030
第7計算期間	0.0030
第8計算期間	0.0030
第9計算期間	0.0030
第10計算期間	0.0030
第11計算期間	0.0030
第12計算期間	0.0030
第13計算期間	0.0030
第14計算期間	0.0030
第15計算期間	0.0030
第16計算期間	0.0030
第17計算期間	0.0080

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1特定期間	1.7
第2特定期間	1.4
第4計算期間	1.2
第5計算期間	1.5
第6計算期間	7.3
第7計算期間	1.7
第8計算期間	2.9
第9計算期間	4.6
第10計算期間	0.1
第11計算期間	0.0
第12計算期間	3.3
第13計算期間	1.4
第14計算期間	1.2
第15計算期間	6.2
第16計算期間	1.9
第17計算期間	2.3

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）特定期間の収益率は、各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	50,000,000	0
第2特定期間	0	0
第4計算期間	844,538,323	50,979,041
第5計算期間	3,174,425,855	96,482,762
第6計算期間	6,639,205,080	645,472,921
第7計算期間	16,792,100,733	843,066,957
第8計算期間	5,531,718,781	2,433,705,327
第9計算期間	2,334,562,803	2,849,184,376
第10計算期間	8,018,264,356	2,525,414,015
第11計算期間	23,156,860,002	4,001,221,708
第12計算期間	31,107,752,180	9,142,866,802
第13計算期間	22,536,763,057	6,150,567,476
第14計算期間	17,417,751,561	6,817,081,474
第15計算期間	23,826,278,649	16,952,417,502
第16計算期間	54,251,614,296	15,683,190,372
第17計算期間	56,117,429,412	17,311,597,198

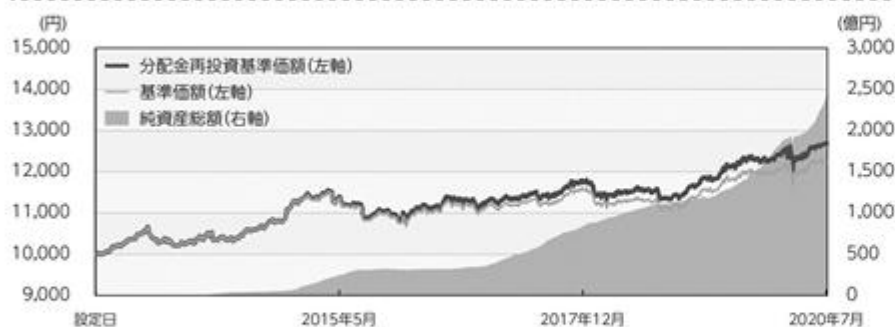
（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2020年7月31日

基準価額・純資産の推移 (2012年10月26日~2020年7月31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:2012年10月26日)

分配の推移(税引前)

2018年 7月	30円
2019年 1月	30円
2019年 7月	30円
2020年 1月	30円
2020年 7月	80円
設定来累計	410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	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	55.40
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	12.90
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.28
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	3.33
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.17
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.88
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.95
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.88

■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(%)	償還日	比率(%)
1	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.04
2	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/6/20	0.98
3	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.95
4	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/9/20	0.93
5	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/3/20	0.93

■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	3.25
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.41
3	ソニー	株式	日本	電気機器	2.37
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.88
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.50

○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:2020年7月31日

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.5 09/30/21	国債証券	アメリカ	1.5	2021/9/30	0.58
2	US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	アメリカ	1.75	2023/5/15	0.57
3	US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	アメリカ	1.625	2022/11/15	0.56
4	FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	フランス	3	2022/4/25	0.45
5	FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	フランス	0.5	2026/5/25	0.44

■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	4.07
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.56
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	3.12
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.37
5	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.13

■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	6.47
2	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	6.23
3	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.10
4	GLP投資法人	投資証券	日本	5.70
5	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.78

■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	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.89
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	6.11
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.78
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.64
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.02

○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:2020年7月31日

■エマージング債券パッシブ・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(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.84
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.70
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.75	2044/3/8	1.57
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.55
5	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625	2050/11/18	1.54

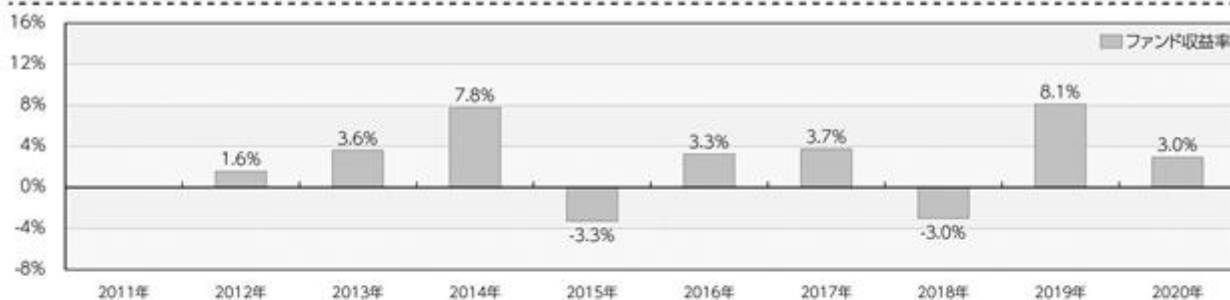
■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

※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	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	6.55
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.47
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	5.01
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.28
5	MEITUAN DIANPING	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.24

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2012年は設定日から年末までの収益率、および2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○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】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行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を行いません。

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

受益権の取得申込者は委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、委託会社または販売会社は、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、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

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あた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、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、1口単位となります。

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。

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、委託会社に対し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、信託契約の一部を解約します。

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受

益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

委託会社は、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）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
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
株式	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
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。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（ 2 ）【保管】

該当事項はありません。

（ 3 ）【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

ただし、下記(5)その他 イ . の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（ 4 ）【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により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。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 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。
- g. 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、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、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.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 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違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

- 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、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

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。

また、投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）の間の当該契約は、原則として期間満了の90日前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドの信託終了まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年1月11日、7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】

(1) 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。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 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。

(3) 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。

(4)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ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎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、第17期計算期間(令和2年1月15日から令和2年7月13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】

【投資のソムリエ】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 令和2年1月14日現在	第17期 令和2年7月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,747,196,981	29,446,481,891
親投資信託受益証券	174,156,463,764	202,527,657,386
派生商品評価勘定	324,856,270	104,867,270
流動資産合計	180,228,517,015	232,079,006,547
資産合計	180,228,517,015	232,079,006,547
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,188,672,240	1,169,551,760
未払収益分配金	442,470,554	1,490,368,137
未払解約金	185,232,909	309,651,451
未払受託者報酬	41,688,544	53,596,312
未払委託者報酬	1,125,591,630	1,447,101,748
その他未払費用	1,791,657	2,098,652
流動負債合計	2,985,447,534	4,472,368,060
負債合計	2,985,447,534	4,472,368,060
純資産の部		
元本等		
元本	147,490,184,943	186,296,017,157
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,752,884,538	41,310,621,330
（分配準備積立金）	6,886,452,838	9,233,578,683
元本等合計	177,243,069,481	227,606,638,487
純資産合計	177,243,069,481	227,606,638,487
負債純資産合計	180,228,517,015	232,079,006,547

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期 自 令和1年7月12日 至 令和2年1月14日	第17期 自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,977,529,897	6,341,081,385
為替差損益	972,260,420	169,114,810
営業収益合計	4,005,269,477	6,171,966,575
営業費用		
支払利息	4,302,187	5,018,024
受託者報酬	41,688,544	53,596,312
委託者報酬	1,125,591,630	1,447,101,748
その他費用	1,802,457	2,098,652
営業費用合計	1,173,384,818	1,507,814,736
営業利益又は営業損失()	2,831,884,659	4,664,151,839
経常利益又は経常損失()	2,831,884,659	4,664,151,839
当期純利益又は当期純損失()	2,831,884,659	4,664,151,839
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()	163,462,636	131,635,115
期首剰余金又は期首欠損金()	19,810,885,050	29,752,884,538
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,595,150,218	12,023,099,787
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,595,150,218	12,023,099,787
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,879,102,199	3,507,511,582
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,879,102,199	3,507,511,582
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	442,470,554	1,490,368,137
期末剰余金又は期末欠損金()	29,752,884,538	41,310,621,330

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第17期	
	自 令和2年1月15日	至 令和2年7月13日
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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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によって計算しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を令和2年1月14日、当計算期間末日を令和2年7月13日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第16期	第17期
	令和2年1月14日現在	令和2年7月13日現在
1. 期首元本額	108,921,761,019円	147,490,184,943円
期中追加設定元本額	54,251,614,296円	56,117,429,412円
期中一部解約元本額	15,683,190,372円	17,311,597,198円
2. 受益権の総数	147,490,184,943口	186,296,017,157口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第16期	第17期
	自 令和1年7月12日 至 令和2年1月14日	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,288,933,070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(1,379,488,953円)、信託約款に規定される収益調整金(22,866,431,700円)及び分配準備積立金(4,660,501,369円)より分配対象収益は30,195,355,092円(1万口当たり2,047.27円)であり、うち442,470,554円(1万口当たり30円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,419,260,516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(3,113,256,208円)、信託約款に規定される収益調整金(32,077,042,647円)及び分配準備積立金(6,191,430,096円)より分配対象収益は42,800,989,467円(1万口当たり2,297.47円)であり、うち1,490,368,137円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第16期 自 令和1年7月12日 至 令和2年1月14日	第17期 自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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	第16期 令和2年1月14日現在	第17期 令和2年7月13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	第16期 令和2年1月14日現在	第17期 令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,105,184,496	7,629,144,977
合計	4,105,184,496	7,629,144,977

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第16期 令和2年1月14日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	58,409,637,560	-	59,597,579,000	1,187,941,440
アメリカ・ドル	10,449,557,010	-	10,638,320,000	188,762,990
イギリス・ポンド	18,125,668,720	-	18,388,514,000	262,845,280
オーストラリア・ドル	7,838,390,950	-	8,073,485,000	235,094,050
カナダ・ドル	8,553,033,680	-	8,789,436,000	236,402,320
ユーロ	13,442,987,200	-	13,707,824,000	264,836,800
買建	21,684,139,530	-	22,008,265,000	324,125,470
アメリカ・ドル	7,071,604,950	-	7,143,500,000	71,895,050
イギリス・ポンド	998,655,000	-	1,000,930,000	2,275,000
オーストラリア・ドル	1,871,947,000	-	1,921,535,000	49,588,000
カナダ・ドル	3,451,854,000	-	3,535,980,000	84,126,000
ユーロ	8,290,078,580	-	8,406,320,000	116,241,420
合計	80,093,777,090	-	81,605,844,000	863,815,970

種類	第17期 令和2年7月13日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	41,435,683,690	-	42,521,323,000	1,085,639,310
アメリカ・ドル	3,485,430,060	-	3,470,675,000	14,755,060
イギリス・ポンド	17,527,737,620	-	17,948,350,000	420,612,380
オーストラリア・ドル	7,889,944,800	-	8,385,730,000	495,785,200
カナダ・ドル	6,920,082,350	-	7,106,344,000	186,261,650
ユーロ	5,612,488,860	-	5,610,224,000	2,264,860
買建	6,657,996,180	-	6,678,951,000	20,954,820
アメリカ・ドル	1,264,243,500	-	1,249,443,000	14,800,500
イギリス・ポンド	1,032,749,640	-	1,052,610,000	19,860,360
オーストラリア・ドル	2,775,910,330	-	2,812,559,000	36,648,670
カナダ・ドル	1,585,092,710	-	1,564,339,000	20,753,710
合計	48,093,679,870	-	49,200,274,000	1,064,684,490

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第16期 令和2年1月14日現在	第17期 令和2年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2017円 (12,017円)	1,2217円 (12,217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

令和2年7月13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	3,167,430,752	7,999,346,364	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	7,718,472,827	10,077,238,122	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	4,159,292,479	7,837,770,747	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,191,275,386	4,544,119,959	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	4,112,034,505	4,416,736,261	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	88,375,585,134	130,460,038,774	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	6,164,734,624	7,088,828,344	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	14,730,660,998	30,103,578,815	
親投資信託受益証券 合計		129,619,486,705	202,527,657,386	
合計			202,527,657,386	

(注) 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

「(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。

(参考)

当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」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」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	751,840,324
国債証券	166,945,529,900
地方債証券	16,806,333,000
特殊債券	15,632,657,858
社債券	9,579,609,360
未収入金	401,766,600
未収利息	372,543,780
前払費用	13,730,403
流動資産合計	210,504,011,225
資産合計	210,504,011,225
負債の部	
流動負債	
未払解約金	51,280,000
流動負債合計	51,280,000
負債合計	51,280,000
純資産の部	
元本等	
元本	161,198,349,379
剰余金	
剰余金又は欠損金()	49,254,381,846
元本等合計	210,452,731,225
純資産合計	210,452,731,225
負債純資産合計	210,504,011,225

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
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	令和2年7月13日現在
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	170,923,484,775円
同期中追加設定元本額	52,837,550,281円
同期中一部解約元本額	62,562,685,677円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	19,418,194,396円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	76,387,550円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	62,545,953円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	14,180,445円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	843,489,961円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	246,008,369円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,737,433円
たわらノーロード 国内債券	11,269,102,945円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	865,493,214円
たわらノーロード バランス(堅実型)	289,560,856円
たわらノーロード バランス(標準型)	463,389,849円
たわらノーロード バランス(積極型)	54,936,684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)	18,805,316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)	538,885,163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)	514,737,776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)	125,331,131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)	9,233,131円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	8,344,067円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	6,400,063円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	11,021,034円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,631,774円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	758,084円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,982,837,879円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	7,090,015,816円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	9,313,872,662円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,649,251,545円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,825,688,011円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,939,314,057円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	308,751,808円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	75,324,315円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,238,625,325円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,343,546円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,523,149,588円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,011,014,146円

D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国30)	203,004,179円
投資のソムリエ	7,718,472,827円
クルーズコントロール	1,655,997,030円
投資のソムリエ<DC年金>	714,982,545円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	3,097,186,147円
4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	384,803,504円
クルーズコントロール<DC年金>	1,625,345円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	3,983,726円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	11,899,065円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,279,020,170円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	11,814,726,005円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,117,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,966,890円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	12,161,087円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	13,844,159円
4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	442,871,655円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	950,399,505円
9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,614,058,920円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,172,877円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	860,187円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	895,992円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	7,403,858円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,401,009円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,860,811,325円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	663,689,320円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	323,753,360円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,259,960,022円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,250,860,114円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,237,091,282円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,226,120,948円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,230,659,249円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	2,429,108円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	199,810,907円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	141,385,750円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	53,504,597円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	124,626,466円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	60,871,166円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	23,648,604円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	74,379,322円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	160,738,977円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,320,082,886円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,466,235,437円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,621,542,555円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	490,291,264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)	222,109,341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)	2,606,546,330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)	222,975,138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)	12,831,163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)	52,648,893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)	2,362,999,576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)	62,394,331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)	478,274,167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)	836,852,058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)	1,239,954,847円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	334,186,362円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	106,339,314円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	48,376,429円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	726,521円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	395,889円
O n eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,034,577,783円
計	161,198,349,379円
2. 受益権の総数	161,198,349,379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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		2,535,967,000
地方債証券		83,666,000
特殊債券		129,446,448
社債券		51,085,270
合計		2,800,164,718

(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（令和2年2月15日から令和2年7月13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)

令和2年7月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3056円 (13,056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

令和2年7月13日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	406回 利付国庫債券(2年)	990,000,000	993,484,800	
	407回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,740,000	
	408回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,176,000	
	410回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	502,165,000	
	411回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	502,320,000	
	412回 利付国庫債券(2年)	300,000,000	301,404,000	
	413回 利付国庫債券(2年)	400,000,000	401,884,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	1,120,000,000	1,123,516,800	
	130回 利付国庫債券(5年)	1,780,000,000	1,786,781,800	

131回 利付国庫債券(5年)	1,420,000,000	1,426,219,600	
132回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,507,260,000	
133回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,186,466,400	
134回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,187,209,800	
135回 利付国庫債券(5年)	1,040,000,000	1,046,999,200	
136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,259,200,000	
137回 利付国庫債券(5年)	700,000,000	705,600,000	
138回 利付国庫債券(5年)	1,450,000,000	1,462,252,500	
139回 利付国庫債券(5年)	1,220,000,000	1,230,833,600	
140回 利付国庫債券(5年)	1,390,000,000	1,402,913,100	
141回 利付国庫債券(5年)	1,410,000,000	1,423,338,600	
142回 利付国庫債券(5年)	960,000,000	969,196,800	
143回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,211,856,000	
2回 利付国庫債券(40年)	280,000,000	399,403,200	
3回 利付国庫債券(40年)	290,000,000	416,880,800	
4回 利付国庫債券(40年)	430,000,000	622,794,800	
5回 利付国庫債券(40年)	400,000,000	561,028,000	
6回 利付国庫債券(40年)	450,000,000	622,602,000	
7回 利付国庫債券(40年)	450,000,000	599,616,000	
8回 利付国庫債券(40年)	520,000,000	647,790,000	
9回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	745,304,000	
10回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	764,281,000	
11回 利付国庫債券(40年)	550,000,000	582,906,500	
12回 利付国庫債券(40年)	570,000,000	546,099,900	
13回 利付国庫債券(40年)	180,000,000	172,571,400	
319回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	814,560,000	
320回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	915,084,000	
321回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	815,648,000	
322回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	508,935,000	

3 2 3 回 利付国庫債券(10年)	750,000,000	765,270,000	
3 2 4 回 利付国庫債券(10年)	1,050,000,000	1,069,341,000	
3 2 5 回 利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,122,913,000	
3 2 6 回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	510,385,000	
3 2 7 回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,227,864,000	
3 2 8 回 利付国庫債券(10年)	1,590,000,000	1,622,102,100	
3 2 9 回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,819,276,800	
3 3 0 回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	669,662,500	
3 3 1 回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	665,496,000	
3 3 2 回 利付国庫債券(10年)	1,860,000,000	1,907,839,200	
3 3 3 回 利付国庫債券(10年)	990,000,000	1,017,106,200	
3 3 4 回 利付国庫債券(10年)	930,000,000	957,035,100	
3 3 5 回 利付国庫債券(10年)	1,940,000,000	1,991,022,000	
3 3 6 回 利付国庫債券(10年)	360,000,000	369,950,400	
3 3 7 回 利付国庫債券(10年)	1,340,000,000	1,365,084,800	
3 3 8 回 利付国庫債券(10年)	1,830,000,000	1,873,920,000	
3 3 9 回 利付国庫債券(10年)	1,940,000,000	1,988,577,600	
3 4 0 回 利付国庫債券(10年)	1,750,000,000	1,796,077,500	
3 4 1 回 利付国庫債券(10年)	1,610,000,000	1,645,645,400	
3 4 2 回 利付国庫債券(10年)	1,980,000,000	2,002,611,600	
3 4 3 回 利付国庫債券(10年)	2,080,000,000	2,104,814,400	
3 4 4 回 利付国庫債券(10年)	1,580,000,000	1,599,655,200	
3 4 5 回 利付国庫債券(10年)	2,010,000,000	2,036,029,500	
3 4 6 回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,793,806,500	
3 4 7 回 利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,936,663,600	

348回 利付国庫債券(10年)	1,680,000,000	1,703,688,000	
349回 利付国庫債券(10年)	1,760,000,000	1,785,027,200	
350回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,230,602,000	
351回 利付国庫債券(10年)	1,560,000,000	1,581,153,600	
352回 利付国庫債券(10年)	1,720,000,000	1,742,635,200	
353回 利付国庫債券(10年)	1,540,000,000	1,558,895,800	
354回 利付国庫債券(10年)	1,220,000,000	1,234,335,000	
355回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,212,888,000	
356回 利付国庫債券(10年)	1,280,000,000	1,292,352,000	
357回 利付国庫債券(10年)	1,260,000,000	1,271,277,000	
358回 利付国庫債券(10年)	1,250,000,000	1,260,262,500	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	125,663,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	122,935,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,710,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,780,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	240,478,000	
11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	239,028,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,944,000	
13回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,956,000	
14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	375,967,600	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,714,000	
16回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	197,592,000	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,366,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	414,665,600	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,774,000	
20回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	266,422,000	
21回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,128,000	
22回 利付国庫債券(30年)	220,000,000	294,696,600	

23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,544,000	
24回 利付国庫債券(30年)	190,000,000	255,907,200	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,684,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	534,724,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	571,015,200	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	655,665,600	
29回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	758,878,400	
30回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	765,578,400	
31回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	611,896,600	
32回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	825,988,800	
33回 利付国庫債券(30年)	790,000,000	1,028,967,100	
34回 利付国庫債券(30年)	740,000,000	996,336,000	
35回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,075,192,200	
36回 利付国庫債券(30年)	790,000,000	1,039,079,100	
37回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	935,308,800	
38回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	730,626,000	
39回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	665,805,000	
40回 利付国庫債券(30年)	450,000,000	578,155,500	
41回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	505,996,000	
42回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	645,741,600	
43回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	506,940,000	
44回 利付国庫債券(30年)	490,000,000	621,565,000	
45回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	587,716,800	
46回 利付国庫債券(30年)	630,000,000	771,806,700	
47回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	637,199,100	

48回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	710,365,900	
49回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	602,225,000	
50回 利付国庫債券(30年)	540,000,000	572,956,200	
51回 利付国庫債券(30年)	550,000,000	517,027,500	
52回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	602,326,200	
53回 利付国庫債券(30年)	550,000,000	555,703,500	
54回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	529,700,000	
55回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	550,492,800	
56回 利付国庫債券(30年)	440,000,000	465,462,800	
57回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	624,414,700	
58回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	634,512,000	
59回 利付国庫債券(30年)	580,000,000	598,165,600	
60回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	541,380,000	
61回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	515,270,000	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	488,960,000	
63回 利付国庫債券(30年)	470,000,000	446,824,300	
64回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	474,570,000	
65回 利付国庫債券(30年)	470,000,000	445,921,900	
66回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	493,173,200	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	382,770,500	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	372,058,600	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	154,561,400	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	208,842,300	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	266,275,200	
85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	495,176,000	

88回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	400,025,500	
90回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	342,843,000	
92回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	993,653,100	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	285,220,000	
94回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	516,424,500	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	408,509,500	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	582,815,000	
99回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	523,575,000	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	705,468,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	430,772,400	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	470,884,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	414,900,500	
107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	472,452,000	
108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	465,680,000	
109回 利付国庫債券(20年)	220,000,000	256,960,000	
110回 利付国庫債券(20年)	330,000,000	391,185,300	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	347,620,100	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	654,357,000	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	918,964,200	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	658,669,000	
115回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	241,402,000	
116回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	387,596,800	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	781,027,000	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	370,670,100	
119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	352,767,000	

120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	462,428,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	641,892,600	
122回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	412,492,500	
123回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	545,485,500	
124回 利付国庫債券(20年)	390,000,000	468,705,900	
125回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	441,536,400	
126回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	409,791,800	
127回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	203,092,200	
128回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	658,498,500	
129回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	344,064,700	
130回 利付国庫債券(20年)	580,000,000	689,834,600	
131回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	353,490,000	
132回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	377,888,000	
133回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	381,504,000	
134回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	513,815,600	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	414,186,500	
136回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	351,555,000	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	415,061,500	
138回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	441,696,800	
139回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	410,945,500	
140回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	903,138,400	
141回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	773,935,500	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	481,156,000	
143回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	602,029,500	
144回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	408,803,500	

145回 利付国庫債券(20年)	810,000,000	968,063,400	
146回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,017,722,000	
147回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,162,554,400	
148回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	869,270,600	
149回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,058,607,000	
150回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,163,930,000	
151回 利付国庫債券(20年)	810,000,000	920,411,100	
152回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	898,190,500	
153回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,026,009,800	
154回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	968,141,500	
155回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	964,821,300	
156回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	691,736,800	
157回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	837,071,500	
158回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	700,991,600	
159回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	889,244,500	
160回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	689,656,500	
161回 利付国庫債券(20年)	580,000,000	605,595,400	
162回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	792,725,600	
163回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	802,286,100	
164回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	778,331,200	
165回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	685,222,400	
166回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	792,847,500	
167回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	714,469,000	
168回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	701,218,000	
169回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	736,792,500	

	170回 利付国庫債券(20年)	620,000,000	607,866,600	
	171回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	743,606,800	
	172回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	477,816,000	
国債証券 合計		153,840,000,000	166,945,529,900	
地方債証券	701回 東京都公募公債	700,000,000	707,973,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	508,370,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	307,395,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	409,616,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,727,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	228,090,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	341,655,000	
	30年度14回 北海道公募公債	300,000,000	302,010,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	305,559,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	306,147,000	
	19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	117,931,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	202,970,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	304,959,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	308,136,000	
	10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	234,534,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	356,916,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,830,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	312,492,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	202,794,000	
	8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	213,636,000	
	1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	110,963,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	509,030,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	307,125,000	
	30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	200,170,000	
	27年度2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	100,959,000	
	26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	409,388,000	
	14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	348,906,000	
	25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	204,808,000	
	24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	348,978,000	
	24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	305,196,000	
	25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	205,046,000	

14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,545,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,353,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,135,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	711,788,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,065,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,500,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,357,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,130,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,256,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,152,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,140,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,415,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,000,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	460,692,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	114,993,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	304,122,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	456,120,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	410,296,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	204,518,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	201,626,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	115,821,000	
地方債証券 合計	16,250,000,000	16,806,333,000	
特殊債券			
78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,406,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	223,647,000	
26回 高速道路機構債	200,000,000	273,110,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	711,648,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	102,139,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	195,624,000	
18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	307,623,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	584,580,000	
149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	405,784,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,680,000	

193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,220,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	338,959,500	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,144,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,130,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	234,678,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	804,600,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,498,000	
28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	529,776,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	232,208,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	235,800,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,259,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,276,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	408,508,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	513,825,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	555,864,360	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,549,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	226,298,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,880,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	234,876,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	214,624,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	236,384,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	419,125,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,857,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,820,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,189,000	37,215,681	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	25,460,000	26,319,275	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,139,000	39,431,912	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	40,488,000	42,145,983	

	1 3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,546,000	11,674,276	
	1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,045,000	58,597,588	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,350,000	13,940,470	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,484,000	53,393,026	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,586,000	39,997,861	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,645,000	65,596,992	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,445,000	145,566,804	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	222,112,000	235,503,132	
	1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	252,378,000	253,445,558	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,626,000	268,234,447	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,157,000	268,581,690	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	271,101,000	273,166,789	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	270,591,000	272,652,903	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	279,159,000	282,673,611	
	い第828号 利付商工債	100,000,000	100,115,000	
	3 2 5 回 利附信金中金債	400,000,000	400,116,000	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	117,149,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	510,740,000	
	特殊債券 合計	14,711,501,000	15,632,657,858	
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	199,264,000	
	6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	203,454,000	
	3 4 回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,616,000	
	1 9 回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,799,000	
	6 回 J Xホールディングス社債	100,000,000	102,691,000	
	1 4 回 プリDESTON社債	200,000,000	199,814,000	
	2 3 回 ジェイ エフ イーホールディングス社債	100,000,000	99,676,000	
	1 3 回 パナソニック社債	100,000,000	100,760,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,836,000	
	1 6 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,074,000	
	9 4 回 丸紅社債	100,000,000	102,114,000	
	4 5 回 住友商事社債	100,000,000	101,689,000	
	4 7 回 住友商事社債	100,000,000	102,139,000	

48回	クレディセゾン社債	100,000,000	102,386,000	
57回	東京三菱銀行社債	200,000,000	209,510,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,252,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	101,798,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	203,514,000	
56回	三菱UFJリース社債	200,000,000	201,102,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	108,608,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	199,816,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	107,799,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	99,010,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,718,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,251,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	328,098,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	220,120,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	207,516,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	318,705,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,703,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	307,845,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	213,234,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,745,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	135,506,400	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,502,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	412,308,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	102,773,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	104,415,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	414,056,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	205,194,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	207,256,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	413,000,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	201,402,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	165,726,960	
340回	北海道電力社債	300,000,000	302,580,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	217,678,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	308,535,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	308,091,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	103,394,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	102,148,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,388,000	
社債券 合計		9,281,000,000	9,579,609,360	
合計			208,964,130,118	

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。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,141,002,143
株式	217,173,457,940
派生商品評価勘定	15,878,270
未収配当金	338,262,463
前払金	68,475,000
流動資産合計	220,737,075,816
資産合計	220,737,075,816
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,906,400
未払金	10,748,940
未払解約金	59,957,000
流動負債合計	75,612,340
負債合計	75,612,340
純資産の部	
元本等	
元本	87,372,996,024
剰余金	
剰余金又は欠損金()	133,288,467,452
元本等合計	220,661,463,476
純資産合計	220,661,463,476
負債純資産合計	220,737,075,816

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
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	令和2年7月13日現在
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	96,962,453,569円
同期中追加設定元本額	27,472,705,558円
同期中一部解約元本額	37,062,163,103円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	15,050,761,054円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,090,580,497円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,120,128円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,821,766円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,739,111円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	34,449,643円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,897,440円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,302,652円
たわらノーロード TOPIX	710,048,951円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	470,581,353円
たわらノーロード バランス(堅実型)	16,884,951円
たわらノーロード バランス(標準型)	102,134,295円
たわらノーロード バランス(積極型)	152,609,634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)	627,189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)	42,450,295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)	130,238,803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)	84,640,117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)	156,926,657円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	353,928円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,253,698円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,834,136円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,168,639円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,279,987円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,201,008,828円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,093,375,687円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,573,116,747円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,554,404,496円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	368,128,460円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,251,487,994円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,134,303,400円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	38,326,565円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,138,688,254円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	22,648,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	331,030,179円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	263,393,479円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	424,212,601円
投資のソムリエ	3,167,430,752円
クルーズコントロール	962,425,851円
投資のソムリエ<DC年金>	293,471,669円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	304,923,106円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	366,572,528円
クルーズコントロール<DC年金>	946,601円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,873,003円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	20,747,672円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	122,596,617円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,132,951,435円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	8,764,431円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,881,928円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,165,676円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	11,363,689円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	88,896,621円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	495,877,499円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	252,177,142円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,289,656円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,060,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,090,717円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,103,215円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	59,462,332円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	72,273,333円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	51,392,405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)	126,877,220円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	92,783,549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)	86,864,930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)	184,781,207円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,962,362円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	43,340,425円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,700,256円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,254,003円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	25,866,895円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,899,593円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	844,922,698円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	857,723,708円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,411,383,415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)	170,487,551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)	46,372,672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)	452,714,259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)	116,339,343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)	2,229,883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)	33,240,956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)	462,068,997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)	32,554,336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)	124,726,708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)	327,422,838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)	388,008,214円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	53,016,365円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	23,834,958円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	2,372,174円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	108,403円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	124,308円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	404,410,942円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,274,945,305円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,685,747,142円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	67,341,342円
計	87,372,996,024円
2. 受益権の総数	87,372,996,024口
3. 差入代用有価証券 株式	1,690,500,000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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	14,533,620,322
合計	14,533,620,322

(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(令和2年2月8日から令和2年7月13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	令和2年7月13日現在			
	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	2,516,675,000	-	2,527,700,000	11,025,000
合計	2,516,675,000	-	2,527,700,000	11,025,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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)

令和2年7月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5255円 (25,255円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年7月13日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	4,700	2,725.00	12,807,500	
日本水産	133,500	466.00	62,211,000	
マルハニチロ	19,300	2,129.00	41,089,700	
ハウスイ	700	905.00	633,500	
カネコ種苗	4,100	1,321.00	5,416,100	
サカタのタネ	16,000	3,315.00	53,040,000	
ホクト	10,200	2,011.00	20,512,200	
ホクリヨウ	2,300	638.00	1,467,400	
ヒノキヤグループ	3,300	1,577.00	5,204,100	
ショーボンドホールディングス	20,800	4,800.00	99,840,000	
ミライト・ホールディングス	39,700	1,567.00	62,209,900	
タマホーム	7,300	1,245.00	9,088,500	
サンヨーホームズ	1,100	617.00	678,700	
日本アクア	5,300	623.00	3,301,900	
ファーストコーポレーション	4,300	578.00	2,485,400	
ベステラ	2,500	1,014.00	2,535,000	
TATERU	28,200	178.00	5,019,600	
スペースバリューホールディングス	16,600	357.00	5,926,200	
住石ホールディングス	28,200	119.00	3,355,800	

日鉄鉱業	3,100	4,160.00	12,896,000
三井松島ホールディングス	5,300	773.00	4,096,900
国際石油開発帝石	536,200	634.30	340,111,660
石油資源開発	17,500	1,821.00	31,867,500
K&Oエナジーグループ	6,500	1,474.00	9,581,000
ダイセキ環境ソリューション	2,700	802.00	2,165,400
第一カッター興業	1,700	2,550.00	4,335,000
安藤・間	79,500	605.00	48,097,500
東急建設	39,100	550.00	21,505,000
コムシスホールディングス	47,400	3,170.00	150,258,000
ビーアールホールディングス	14,900	581.00	8,656,900
高松コンストラクショングループ	8,300	2,361.00	19,596,300
東建コーポレーション	4,200	7,190.00	30,198,000
ソネック	1,500	789.00	1,183,500
ヤマウラ	5,800	815.00	4,727,000
大成建設	102,900	3,880.00	399,252,000
大林組	308,400	1,003.00	309,325,200
清水建設	313,100	851.00	266,448,100
飛島建設	8,900	1,068.00	9,505,200
長谷工コーポレーション	119,400	1,353.00	161,548,200
松井建設	12,100	668.00	8,082,800
銭高組	1,300	3,680.00	4,784,000
鹿島建設	242,100	1,259.00	304,803,900
不動テトラ	8,200	1,454.00	11,922,800
大末建設	3,700	819.00	3,030,300
鉄建建設	6,700	2,065.00	13,835,500
西松建設	23,700	2,078.00	49,248,600
三井住友建設	74,500	462.00	34,419,000
大豊建設	7,000	2,426.00	16,982,000
前田建設工業	77,200	784.00	60,524,800
佐田建設	6,900	415.00	2,863,500
ナカノフドー建設	8,400	356.00	2,990,400
奥村組	16,700	2,522.00	42,117,400
東鉄工業	13,200	2,711.00	35,785,200
イチケン	2,300	1,496.00	3,440,800
富士ピー・エス	4,600	610.00	2,806,000
浅沼組	3,500	4,105.00	14,367,500
戸田建設	127,800	711.00	90,865,800
熊谷組	14,200	2,587.00	36,735,400
北野建設	1,900	2,625.00	4,987,500
植木組	1,400	2,521.00	3,529,400
矢作建設工業	13,600	780.00	10,608,000
ピーエス三菱	10,100	527.00	5,322,700
日本ハウスホールディングス	21,900	274.00	6,000,600
大東建託	33,600	9,987.00	335,563,200
新日本建設	13,100	840.00	11,004,000
N I P P O	25,500	2,700.00	68,850,000
東亜道路工業	1,900	3,250.00	6,175,000
前田道路	27,300	1,975.00	53,917,500
日本道路	3,000	7,290.00	21,870,000

東亜建設工業	9,700	1,545.00	14,986,500
日本国土開発	30,100	576.00	17,337,600
若築建設	5,500	1,244.00	6,842,000
東洋建設	34,700	390.00	13,533,000
五洋建設	122,400	584.00	71,481,600
世紀東急工業	14,900	765.00	11,398,500
福田組	3,600	4,870.00	17,532,000
日本ドライケミカル	2,500	1,718.00	4,295,000
住友林業	78,100	1,362.00	106,372,200
日本基礎技術	10,500	410.00	4,305,000
巴コーポレーション	13,900	337.00	4,684,300
大和ハウス工業	305,200	2,480.00	756,896,000
ライト工業	17,700	1,497.00	26,496,900
積水ハウス	334,700	2,073.50	694,000,450
日特建設	8,100	774.00	6,269,400
北陸電気工事	5,300	946.00	5,013,800
ユアテック	17,600	644.00	11,334,400
日本リーテック	6,500	2,779.00	18,063,500
四電工	1,700	2,375.00	4,037,500
中電工	12,300	2,230.00	27,429,000
関電工	43,900	900.00	39,510,000
きんでん	73,300	1,765.00	129,374,500
東京エネシス	10,300	737.00	7,591,100
トーエネック	3,100	3,700.00	11,470,000
住友電設	8,700	2,394.00	20,827,800
日本電設工業	16,900	2,304.00	38,937,600
協和エクシオ	46,800	2,562.00	119,901,600
新日本空調	8,200	2,358.00	19,335,600
日本工営	6,300	2,942.00	18,534,600
九電工	21,700	3,130.00	67,921,000
三機工業	22,200	1,208.00	26,817,600
日揮ホールディングス	95,000	1,145.00	108,775,000
中外炉工業	3,300	1,573.00	5,190,900
ヤマト	10,000	620.00	6,200,000
太平電業	7,500	2,245.00	16,837,500
高砂熱学工業	26,800	1,557.00	41,727,600
三晃金属工業	1,400	2,051.00	2,871,400
NEC ネットエスアイ	27,500	2,234.00	61,435,000
朝日工業社	2,100	3,195.00	6,709,500
明星工業	20,000	810.00	16,200,000
大気社	15,000	3,055.00	45,825,000
ダイダン	7,400	2,723.00	20,150,200
日比谷総合設備	9,900	1,835.00	18,166,500
日本製粉	28,900	1,680.00	48,552,000
日清製粉グループ本社	111,600	1,594.00	177,890,400
日東富士製粉	700	5,940.00	4,158,000
昭和産業	9,100	3,310.00	30,121,000
鳥越製粉	8,800	888.00	7,814,400
中部飼料	12,100	1,635.00	19,783,500
フィード・ワン	66,800	188.00	12,558,400

東洋精糖	1,800	1,154.00	2,077,200
日本甜菜製糖	5,100	1,719.00	8,766,900
三井製糖	8,600	1,969.00	16,933,400
塩水港精糖	11,300	230.00	2,599,000
日新製糖	4,500	1,805.00	8,122,500
L I F U L L	33,100	427.00	14,133,700
ジェイエイシーリクルートメント	6,500	1,072.00	6,968,000
日本M&Aセンター	71,100	4,970.00	353,367,000
メンバーズ	2,900	1,408.00	4,083,200
中広	1,300	528.00	686,400
UTグループ	14,900	2,694.00	40,140,600
アイティメディア	2,900	1,886.00	5,469,400
タケエイ	9,100	994.00	9,045,400
E・Jホールディングス	1,400	1,930.00	2,702,000
ビーネックスグループ	12,000	1,020.00	12,240,000
コシダカホールディングス	22,900	388.00	8,885,200
アルトナー	2,400	883.00	2,119,200
パソナグループ	10,300	1,205.00	12,411,500
C D S	2,500	1,196.00	2,990,000
リンクアンドモチベーション	21,100	371.00	7,828,100
G C A	11,700	593.00	6,938,100
エス・エム・エス	29,300	2,426.00	71,081,800
サニーサイドアップグループ	2,600	671.00	1,744,600
パーソルホールディングス	94,100	1,438.00	135,315,800
リニカル	4,500	817.00	3,676,500
クックパッド	33,100	328.00	10,856,800
エスクリ	3,000	357.00	1,071,000
アイ・ケイ・ケイ	4,600	550.00	2,530,000
森永製菓	23,100	4,090.00	94,479,000
中村屋	2,600	4,115.00	10,699,000
江崎グリコ	29,300	5,050.00	147,965,000
名糖産業	4,700	1,338.00	6,288,600
井村屋グループ	5,600	2,264.00	12,678,400
不二家	5,400	2,183.00	11,788,200
山崎製パン	74,200	1,814.00	134,598,800
第一屋製パン	1,800	983.00	1,769,400
モロゾフ	1,700	5,430.00	9,231,000
亀田製菓	5,500	5,360.00	29,480,000
寿スピリッツ	9,600	4,330.00	41,568,000
カルビー	45,000	3,060.00	137,700,000
森永乳業	18,300	4,915.00	89,944,500
六甲バター	6,500	1,486.00	9,659,000
ヤクルト本社	68,000	6,380.00	433,840,000
明治ホールディングス	65,400	8,490.00	555,246,000
雪印メグミルク	23,800	2,544.00	60,547,200
プリマハム	15,400	2,842.00	43,766,800
日本ハム	37,800	4,420.00	167,076,000
林兼産業	3,500	561.00	1,963,500
丸大食品	10,500	1,912.00	20,076,000
S F o o d s	7,800	2,543.00	19,835,400

柿安本店	3,500	2,775.00	9,712,500
伊藤ハム米久ホールディングス	63,400	640.00	40,576,000
学情	3,500	1,054.00	3,689,000
スタジオアリス	4,700	1,439.00	6,763,300
クロスキャット	2,700	1,153.00	3,113,100
シミックホールディングス	4,700	1,379.00	6,481,300
エプコ	1,600	1,255.00	2,008,000
システナ	34,500	1,395.00	48,127,500
N J S	2,100	1,781.00	3,740,100
デジタルアーツ	4,700	8,870.00	41,689,000
日鉄ソリューションズ	14,500	2,860.00	41,470,000
総合警備保障	37,500	4,995.00	187,312,500
キューブシステム	5,200	982.00	5,106,400
いちご	123,800	255.00	31,569,000
エイジア	1,800	1,400.00	2,520,000
日本駐車場開発	96,600	141.00	13,620,600
コア	4,300	1,209.00	5,198,700
カカクコム	69,500	2,826.00	196,407,000
アイロムグループ	3,400	2,377.00	8,081,800
セントケア・ホールディング	6,200	418.00	2,591,600
サイネックス	1,600	702.00	1,123,200
ルネサンス	5,300	921.00	4,881,300
ディップ	13,300	2,261.00	30,071,300
S B Sホールディングス	8,500	2,235.00	18,997,500
デジタルホールディングス	5,100	1,448.00	7,384,800
新日本科学	10,400	619.00	6,437,600
ツクイ	22,300	492.00	10,971,600
キャリアデザインセンター	2,500	811.00	2,027,500
ベネフィット・ワン	34,300	2,226.00	76,351,800
エムスリー	207,300	4,985.00	1,033,390,500
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	271.00	1,653,100
プラス	900	502.00	451,800
アウトソーシング	54,300	630.00	34,209,000
ウェルネット	9,900	636.00	6,296,400
ワールドホールディングス	3,100	1,573.00	4,876,300
ディー・エヌ・エー	39,800	1,324.00	52,695,200
博報堂D Yホールディングス	130,800	1,197.00	156,567,600
ぐるなび	16,500	713.00	11,764,500
タカミヤ	10,200	533.00	5,436,600
ジャパンベストレスキューシステム	6,600	814.00	5,372,400
ファンコミュニケーションズ	26,200	441.00	11,554,200
ライク	3,100	1,288.00	3,992,800
ビジネス・ブレークスルー	4,200	366.00	1,537,200
エスプール	24,500	714.00	17,493,000
W D Bホールディングス	4,400	2,648.00	11,651,200
手間いらず	600	4,270.00	2,562,000
ティア	5,600	484.00	2,710,400
C D G	1,000	1,608.00	1,608,000
バリューコマース	5,300	2,964.00	15,709,200
インフォマート	103,100	713.00	73,510,300

サッポロホールディングス	33,600	1,972.00	66,259,200
アサヒグループホールディングス	206,900	3,700.00	765,530,000
キリンホールディングス	418,800	2,125.50	890,159,400
宝ホールディングス	73,200	975.00	71,370,000
オエノンホールディングス	26,400	412.00	10,876,800
養命酒製造	3,000	1,806.00	5,418,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	69,300	1,920.00	133,056,000
サントリー食品インターナショナル	66,100	4,355.00	287,865,500
ダイドーグループホールディングス	5,100	4,820.00	24,582,000
伊藤園	30,000	6,240.00	187,200,000
キーコーヒー	9,800	2,171.00	21,275,800
ユニカフェ	2,700	999.00	2,697,300
ジャパンフーズ	1,500	1,178.00	1,767,000
日清オイリオグループ	12,700	3,385.00	42,989,500
不二製油グループ本社	24,100	2,899.00	69,865,900
かどや製油	1,100	3,710.00	4,081,000
J・オイルミルズ	5,100	4,040.00	20,604,000
ローソン	24,500	5,710.00	139,895,000
サンエー	8,000	4,100.00	32,800,000
カワチ薬品	7,600	2,915.00	22,154,000
エービーシー・マート	15,100	6,090.00	91,959,000
ハードオフコーポレーション	4,000	700.00	2,800,000
高千穂交易	3,800	902.00	3,427,600
アスクル	10,100	3,675.00	37,117,500
ゲオホールディングス	17,500	1,449.00	25,357,500
アダストリア	13,400	1,610.00	21,574,000
ジーフット	5,900	492.00	2,902,800
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,700	445.00	756,500
伊藤忠食品	2,400	4,995.00	11,988,000
くら寿司	5,100	4,640.00	23,664,000
キャンドウ	4,700	2,163.00	10,166,100
エレマテック	9,100	825.00	7,507,500
パルグループホールディングス	9,800	1,200.00	11,760,000
JALUX	2,800	1,711.00	4,790,800
エディオン	44,400	1,064.00	47,241,600
あらた	7,600	4,750.00	36,100,000
サーラコーポレーション	19,600	572.00	11,211,200
ワッツ	4,400	1,001.00	4,404,400
トーメンデバイス	1,400	3,700.00	5,180,000
ハローズ	3,600	3,450.00	12,420,000
J Pホールディングス	29,800	268.00	7,986,400
フジオフードグループ本社	8,100	1,273.00	10,311,300
あみやき亭	2,100	2,837.00	5,957,700
東京エレクトロン デバイス	3,500	3,765.00	13,177,500
ひらまつ	18,600	174.00	3,236,400
フィールズ	7,600	358.00	2,720,800
双日	534,600	237.00	126,700,200
アルフレッサ ホールディングス	107,700	2,250.00	242,325,000
大黒天物産	2,400	5,950.00	14,280,000

ハニーズホールディングス	8,600	1,169.00	10,053,400	
ファーマライズホールディングス	2,500	696.00	1,740,000	
キッコーマン	71,100	4,980.00	354,078,000	
味の素	218,000	1,767.00	385,206,000	
キューピー	55,000	1,927.00	105,985,000	
ハウス食品グループ本社	37,000	3,380.00	125,060,000	
カゴメ	37,500	3,250.00	121,875,000	
焼津水産化学工業	4,800	862.00	4,137,600	
アリアケジャパン	9,000	6,780.00	61,020,000	
ピエトロ	1,300	1,637.00	2,128,100	
エバラ食品工業	2,400	2,133.00	5,119,200	
やまみ	500	2,270.00	1,135,000	
ニチレイ	47,100	3,140.00	147,894,000	
横浜冷凍	25,200	894.00	22,528,800	
東洋水産	50,900	6,300.00	320,670,000	
イートアンド	3,500	1,776.00	6,216,000	
大冷	1,400	2,035.00	2,849,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,400	1,247.00	6,733,800	
日清食品ホールディングス	42,000	9,680.00	406,560,000	
永谷園ホールディングス	4,800	2,150.00	10,320,000	
一正蒲鉾	3,900	989.00	3,857,100	
フジッコ	10,700	2,028.00	21,699,600	
ロック・フィールド	10,800	1,290.00	13,932,000	
日本たばこ産業	570,100	1,958.00	1,116,255,800	
ケンコーマヨネーズ	5,400	1,909.00	10,308,600	
わらべや日洋ホールディングス	6,500	1,600.00	10,400,000	
なとり	5,400	1,795.00	9,693,000	
イフジ産業	1,700	804.00	1,366,800	
ピクルスコーポレーション	2,200	2,803.00	6,166,600	
北の達人コーポレーション	34,600	542.00	18,753,200	
ユーグレナ	42,800	753.00	32,228,400	
スター・マイカ・ホールディングス	5,100	1,441.00	7,349,100	
A Dワークスグループ	17,800	168.00	2,990,400	
片倉工業	14,100	1,118.00	15,763,800	
グンゼ	7,100	4,145.00	29,429,500	
ヒューリック	207,200	971.00	201,191,200	
神栄	1,600	482.00	771,200	
ラサ商事	5,300	931.00	4,934,300	
アルペン	7,500	1,723.00	12,922,500	
ハブ	2,900	630.00	1,827,000	
ラクーンホールディングス	4,400	1,090.00	4,796,000	
クオールホールディングス	14,200	1,131.00	16,060,200	
アルコニックス	10,300	1,265.00	13,029,500	
神戸物産	33,500	6,700.00	224,450,000	
ソリトンシステムズ	4,400	1,447.00	6,366,800	
ジーンズホールディングス	5,100	7,470.00	38,097,000	
ビックカメラ	57,400	1,218.00	69,913,200	
D C Mホールディングス	53,200	1,312.00	69,798,400	
ペッパーフードサービス	8,300	504.00	4,183,200	
Monotaro	68,900	4,590.00	316,251,000	

東京一番フーズ	2,700	501.00	1,352,700	
DDホールディングス	4,000	809.00	3,236,000	
あいホールディングス	13,900	1,543.00	21,447,700	
ディーブイエックス	3,500	868.00	3,038,000	
きちりホールディングス	2,700	573.00	1,547,100	
アークランドサービスホールディングス	7,200	1,884.00	13,564,800	
J.フロントリテイリング	115,700	675.00	78,097,500	
ドトール・日レスホールディングス	13,900	1,664.00	23,129,600	
マツモトキヨシホールディングス	40,100	3,920.00	157,192,000	
ブロンコピリー	5,100	2,245.00	11,449,500	
ZOZO	66,600	2,701.00	179,886,600	
トレジャー・ファクトリー	3,000	690.00	2,070,000	
物語コーポレーション	2,600	7,840.00	20,384,000	
ココカラファイン	10,100	6,050.00	61,105,000	
三越伊勢丹ホールディングス	169,400	591.00	100,115,400	
東洋紡	38,100	1,487.00	56,654,700	
ユニチカ	28,800	353.00	10,166,400	
富士紡ホールディングス	4,700	3,175.00	14,922,500	
日清紡ホールディングス	65,600	769.00	50,446,400	
倉敷紡績	9,700	2,093.00	20,302,100	
ダイワボウホールディングス	8,200	7,120.00	58,384,000	
シキボウ	5,200	1,015.00	5,278,000	
日東紡績	14,600	5,120.00	74,752,000	
トヨタ紡織	28,500	1,407.00	40,099,500	
マクニカ・富士エレホールディングス	23,100	1,537.00	35,504,700	
Hamee	3,500	1,834.00	6,419,000	
ラクト・ジャパン	3,600	3,640.00	13,104,000	
ウエルシアホールディングス	28,900	8,870.00	256,343,000	
クリエイトSDホールディングス	16,300	3,475.00	56,642,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,100	1,027.00	18,588,700	
八洲電機	7,500	917.00	6,877,500	
メディアスホールディングス	5,400	886.00	4,784,400	
レスターホールディングス	10,000	2,047.00	20,470,000	
ジュテックホールディングス	2,300	994.00	2,286,200	
丸善CHIホールディングス	10,600	394.00	4,176,400	
大光	4,300	631.00	2,713,300	
OCHIホールディングス	2,800	1,461.00	4,090,800	
TOKAIホールディングス	51,200	1,000.00	51,200,000	
黒谷	2,100	459.00	963,900	
ミサワ	2,000	669.00	1,338,000	
ティーライフ	1,400	1,097.00	1,535,800	
Cominix	1,800	704.00	1,267,200	
エー・ピーカンパニー	1,900	423.00	803,700	
三洋貿易	9,900	994.00	9,840,600	
チムニー	3,000	1,269.00	3,807,000	
シュッピン	6,800	721.00	4,902,800	
ビューティガレージ	1,700	2,059.00	3,500,300	
オイシックス・ラ・大地	9,600	2,054.00	19,718,400	

ウイン・パートナーズ	7,000	968.00	6,776,000
ネクステージ	14,100	960.00	13,536,000
ジョイフル本田	28,400	1,473.00	41,833,200
鳥貴族	3,000	1,474.00	4,422,000
キリン堂ホールディングス	3,900	2,893.00	11,282,700
ホットランド	6,600	1,069.00	7,055,400
すかいらーくホールディングス	108,700	1,615.00	175,550,500
SFPホールディングス	4,300	1,431.00	6,153,300
綿半ホールディングス	3,700	1,962.00	7,259,400
日本毛織	31,500	991.00	31,216,500
ダイトウボウ	16,200	114.00	1,846,800
トーア紡コーポレーション	4,000	470.00	1,880,000
ダイドーリミテッド	13,200	196.00	2,587,200
ヨシックス	1,600	1,838.00	2,940,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,100	1,245.00	34,984,500
三栄建築設計	4,000	1,479.00	5,916,000
野村不動産ホールディングス	58,900	1,877.00	110,555,300
三重交通グループホールディングス	19,500	469.00	9,145,500
サムティ	13,800	1,276.00	17,608,800
ディア・ライフ	12,900	486.00	6,269,400
コーセーアールイー	3,000	508.00	1,524,000
日本商業開発	6,200	1,513.00	9,380,600
プレサンスコーポレーション	16,100	1,236.00	19,899,600
フィル・カンパニー	1,400	2,115.00	2,961,000
THEグローバル社	4,600	212.00	975,200
ハウスコム	1,300	1,268.00	1,648,400
日本管理センター	6,500	1,134.00	7,371,000
サンセイランディック	3,000	782.00	2,346,000
エストラスト	1,400	644.00	901,600
フージャースホールディングス	19,400	532.00	10,320,800
オープンハウス	28,200	3,425.00	96,585,000
東急不動産ホールディングス	263,800	444.00	117,127,200
飯田グループホールディングス	80,900	1,762.00	142,545,800
イーランド	1,700	697.00	1,184,900
ムゲンエステート	7,000	499.00	3,493,000
帝国繊維	10,900	2,337.00	25,473,300
日本コークス工業	84,400	64.00	5,401,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,400	518.00	2,279,200
ミタチ産業	2,900	565.00	1,638,500
B E E N O S	3,900	1,178.00	4,594,200
あさひ	7,300	1,559.00	11,380,700
日本調剤	5,800	1,686.00	9,778,800
コスモス薬品	8,500	18,230.00	154,955,000
シップヘルスケアホールディングス	15,600	4,630.00	72,228,000
トーエル	4,700	665.00	3,125,500
ソフトクリエイイトホールディングス	4,300	2,216.00	9,528,800
オンリー	1,700	563.00	957,100
セブン&アイ・ホールディングス	379,200	3,467.00	1,314,686,400

クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	52,200	610.00	31,842,000	
明治電機工業	3,100	1,402.00	4,346,200	
ツルハホールディングス	21,100	14,670.00	309,537,000	
デリカフーズホールディングス	3,500	617.00	2,159,500	
スターティアホールディングス	2,400	611.00	1,466,400	
サンマルクホールディングス	7,600	1,577.00	11,985,200	
フェリシモ	2,100	1,065.00	2,236,500	
トリドールホールディングス	24,000	1,173.00	28,152,000	
帝人	78,600	1,700.00	133,620,000	
東レ	697,600	500.10	348,869,760	
クラレ	151,800	1,115.00	169,257,000	
旭化成	638,800	847.00	541,063,600	
サカイオーベックス	2,600	2,188.00	5,688,800	
TOKYO BASE	9,000	329.00	2,961,000	
稲葉製作所	5,400	1,437.00	7,759,800	
宮地エンジニアリンググループ	3,000	1,647.00	4,941,000	
トーカロ	27,100	1,162.00	31,490,200	
アルファ	3,500	926.00	3,241,000	
SUMCO	115,700	1,632.00	188,822,400	
川田テクノロジーズ	2,000	4,830.00	9,660,000	
RS Technologies	2,800	4,185.00	11,718,000	
信和	4,400	695.00	3,058,000	
ピーロット	4,700	619.00	2,909,300	
ファーストブラザーズ	2,300	735.00	1,690,500	
ハウズドゥ	4,800	868.00	4,166,400	
シーアールイー	2,500	1,590.00	3,975,000	
プロパティエージェント	1,600	1,035.00	1,656,000	
ケイアイスター不動産	3,100	1,781.00	5,521,100	
アグレ都市デザイン	1,700	534.00	907,800	
グッドコムアセット	2,400	1,581.00	3,794,400	
ジェイ・エス・ビー	1,900	2,798.00	5,316,200	
テンポイノベーション	2,400	621.00	1,490,400	
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	628.00	1,067,600	
住江織物	2,100	2,020.00	4,242,000	
日本フェルト	5,600	438.00	2,452,800	
イチカワ	1,400	1,164.00	1,629,600	
エコナックホールディングス	17,700	94.00	1,663,800	
日東製網	1,100	1,390.00	1,529,000	
芦森工業	2,100	990.00	2,079,000	
アツギ	8,100	604.00	4,892,400	
ウイルプラスホールディングス	1,300	594.00	772,200	
JMホールディングス	7,400	3,525.00	26,085,000	
コメダホールディングス	21,200	1,803.00	38,223,600	
サツドラホールディングス	1,500	1,966.00	2,949,000	
アレンザホールディングス	4,800	1,134.00	5,443,200	
串カツ田中ホールディングス	1,600	1,624.00	2,598,400	
パロックジャパンリミテッド	6,900	660.00	4,554,000	
クスリのアオキホールディングス	8,700	10,190.00	88,653,000	
ダイニック	3,500	718.00	2,513,000	

共和レザー	5,200	618.00	3,213,600
力の源ホールディングス	4,400	648.00	2,851,200
スシローグローバルホールディングス	53,200	2,443.00	129,967,600
L I X I L ビバ	9,700	2,596.00	25,181,200
アセンテック	700	4,015.00	2,810,500
セーレン	23,700	1,322.00	31,331,400
ソトー	3,900	945.00	3,685,500
東海染工	1,400	1,128.00	1,579,200
小松マテレ	16,000	733.00	11,728,000
ワコールホールディングス	25,000	1,949.00	48,725,000
ホギメディカル	11,100	3,035.00	33,688,500
クラウドシアホールディングス	2,500	328.00	820,000
T S I ホールディングス	32,100	354.00	11,363,400
マツオカコーポレーション	2,800	1,738.00	4,866,400
ワールド	13,600	1,471.00	20,005,600
T I S	96,600	2,274.00	219,668,400
ネオス	4,100	689.00	2,824,900
電算システム	3,800	4,765.00	18,107,000
グリー	59,200	475.00	28,120,000
コーエーテクモホールディングス	19,800	3,545.00	70,191,000
三菱総合研究所	4,200	4,310.00	18,102,000
ボルテージ	2,100	492.00	1,033,200
電算	1,100	2,135.00	2,348,500
A G S	5,400	777.00	4,195,800
ファインデックス	8,300	925.00	7,677,500
ブレインパッド	2,400	4,460.00	10,704,000
K L a b	18,900	733.00	13,853,700
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	11,900	839.00	9,984,100
イーブックイニシアティブジャパン	1,400	3,150.00	4,410,000
ネクソン	269,300	2,617.00	704,758,100
アイスタイル	27,400	284.00	7,781,600
エムアップホールディングス	2,900	2,457.00	7,125,300
エイチーム	6,800	855.00	5,814,000
エニグモ	7,000	1,277.00	8,939,000
テクノスジャパン	7,900	794.00	6,272,600
e n i s h	4,500	781.00	3,514,500
コロブラ	31,700	1,088.00	34,489,600
オルトプラス	6,000	451.00	2,706,000
ブロードリーフ	48,300	562.00	27,144,600
クロス・マーケティンググループ	4,300	338.00	1,453,400
デジタルハーツホールディングス	5,200	862.00	4,482,400
システム情報	5,100	1,402.00	7,150,200
メディアドゥ	3,100	4,670.00	14,477,000
じげん	24,500	326.00	7,987,000
ブイキューブ	5,900	1,252.00	7,386,800
エンカレッジ・テクノロジー	1,700	845.00	1,436,500
サイバーリンクス	1,600	2,148.00	3,436,800
ディー・エル・イー	8,200	494.00	4,050,800
フィックスターズ	10,400	1,219.00	12,677,600

CARTA HOLDINGS	4,600	1,277.00	5,874,200
オブティム	5,100	3,750.00	19,125,000
セレス	3,300	1,087.00	3,587,100
SHIFT	3,900	11,820.00	46,098,000
特種東海製紙	6,100	4,650.00	28,365,000
ティーガイア	8,500	1,996.00	16,966,000
セック	1,500	3,005.00	4,507,500
日本アジアグループ	10,400	293.00	3,047,200
テクマトリックス	13,800	1,846.00	25,474,800
プロシップ	2,800	1,416.00	3,964,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23,200	2,037.00	47,258,400
GMOペイメントゲートウェイ	20,500	11,870.00	243,335,000
ザッパラス	4,400	399.00	1,755,600
システムリサーチ	2,600	1,935.00	5,031,000
インターネットイニシアティブ	14,200	3,595.00	51,049,000
さくらインターネット	10,600	612.00	6,487,200
ヴィンクス	2,800	1,345.00	3,766,000
GMOクラウド	1,800	8,050.00	14,490,000
SRAホールディングス	5,200	2,322.00	12,074,400
システムインテグレータ	3,300	843.00	2,781,900
朝日ネット	6,900	1,117.00	7,707,300
eBASE	11,700	1,412.00	16,520,400
アバント	7,000	980.00	6,860,000
アドソル日進	3,500	2,317.00	8,109,500
フリービット	5,100	740.00	3,774,000
コムチュア	10,900	2,729.00	29,746,100
サイバーコム	1,800	1,785.00	3,213,000
アステリア	6,100	527.00	3,214,700
アイル	5,400	1,646.00	8,888,400
王子ホールディングス	402,700	484.00	194,906,800
日本製紙	42,300	1,460.00	61,758,000
三菱製紙	11,100	342.00	3,796,200
北越コーポレーション	57,200	376.00	21,507,200
中越パルプ工業	4,100	1,424.00	5,838,400
巴川製紙所	2,900	961.00	2,786,900
大王製紙	42,400	1,449.00	61,437,600
阿波製紙	2,600	490.00	1,274,000
マークライNZ	4,800	2,299.00	11,035,200
メディカル・データ・ビジョン	7,500	1,228.00	9,210,000
gumi	12,600	989.00	12,461,400
ショーケース	2,400	715.00	1,716,000
モバイルファクトリー	2,300	1,008.00	2,318,400
テラスカイ	3,500	2,875.00	10,062,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,000	1,307.00	5,228,000
PCIホールディングス	4,000	1,150.00	4,600,000
パイプドHD	1,300	1,461.00	1,899,300
アイビーシー	1,800	945.00	1,701,000
ネオジャパン	1,900	2,348.00	4,461,200

PR TIMES	900	2,768.00	2,491,200	
ランドコンピュータ	1,500	988.00	1,482,000	
ダブルスタンダード	1,300	5,590.00	7,267,000	
オープンドア	4,800	1,281.00	6,148,800	
マイネット	3,300	1,173.00	3,870,900	
アカツキ	3,400	3,800.00	12,920,000	
ベネフィットジャパン	700	1,553.00	1,087,100	
Ubicomホールディングス	2,300	2,106.00	4,843,800	
LINE	22,100	5,560.00	122,876,000	
カナミックネットワーク	5,900	940.00	5,546,000	
ノムラシステムコーポレーション	4,600	470.00	2,162,000	
レンゴー	91,100	835.00	76,068,500	
トーモク	5,800	1,785.00	10,353,000	
ザ・バック	7,300	2,894.00	21,126,200	
チェンジ	3,400	8,100.00	27,540,000	
シンクロ・フード	4,300	326.00	1,401,800	
オークネット	5,900	1,030.00	6,077,000	
セグエグループ	1,700	880.00	1,496,000	
エイトレッド	1,300	1,978.00	2,571,400	
AOI TYO HOLDINGS	9,900	400.00	3,960,000	
マクロミル	20,000	734.00	14,680,000	
ピーグリー	1,900	1,893.00	3,596,700	
オロ	2,600	2,856.00	7,425,600	
ユーザーローカル	1,000	3,970.00	3,970,000	
テモナ	1,400	977.00	1,367,800	
ニーズウェル	1,400	719.00	1,006,600	
サインポスト	1,600	1,579.00	2,526,400	
昭和電工	68,600	2,322.00	159,289,200	
住友化学	707,700	326.00	230,710,200	
住友精化	4,400	3,610.00	15,884,000	
日産化学	53,500	5,590.00	299,065,000	
ラサ工業	3,500	1,497.00	5,239,500	
クレハ	8,200	4,590.00	37,638,000	
多木化学	3,800	7,270.00	27,626,000	
テイカ	7,100	1,363.00	9,677,300	
石原産業	17,300	706.00	12,213,800	
片倉コープアグリ	2,500	1,208.00	3,020,000	
日本曹達	14,200	2,820.00	40,044,000	
東ソー	148,900	1,476.00	219,776,400	
トクヤマ	27,800	2,490.00	69,222,000	
セントラル硝子	19,600	1,938.00	37,984,800	
東亜合成	60,500	1,083.00	65,521,500	
大阪ソーダ	9,800	2,357.00	23,098,600	
関東電化工業	22,900	858.00	19,648,200	
デンカ	35,300	2,605.00	91,956,500	
イビデン	60,300	3,165.00	190,849,500	
信越化学工業	165,500	12,820.00	2,121,710,000	
日本カーバイド工業	3,300	1,195.00	3,943,500	
堺化学工業	6,200	2,030.00	12,586,000	
第一稀元素化学工業	10,600	735.00	7,791,000	

エア・ウォーター	89,700	1,499.00	134,460,300
大陽日酸	92,600	1,799.00	166,587,400
日本化学工業	3,000	2,175.00	6,525,000
東邦アセチレン	1,500	1,223.00	1,834,500
日本パーカラライジング	48,600	1,108.00	53,848,800
高圧ガス工業	15,400	809.00	12,458,600
チタン工業	1,300	1,739.00	2,260,700
四国化成工業	14,800	1,066.00	15,776,800
戸田工業	2,400	1,749.00	4,197,600
ステラ ケミファ	5,300	2,343.00	12,417,900
保土谷化学工業	3,600	4,785.00	17,226,000
日本触媒	14,900	5,510.00	82,099,000
大日精化工業	8,600	2,359.00	20,287,400
カネカ	24,900	2,647.00	65,910,300
協和キリン	99,000	2,744.00	271,656,000
三菱瓦斯化学	89,700	1,665.00	149,350,500
三井化学	87,500	2,244.00	196,350,000
J S R	89,900	2,151.00	193,374,900
東京応化工業	16,500	5,860.00	96,690,000
大阪有機化学工業	9,000	2,908.00	26,172,000
三菱ケミカルホールディングス	644,100	628.00	404,494,800
K Hネオケム	17,000	2,115.00	35,955,000
ダイセル	125,400	796.00	99,818,400
住友ベークライト	15,200	2,867.00	43,578,400
積水化学工業	203,800	1,530.00	311,814,000
日本ゼオン	86,900	980.00	85,162,000
アイカ工業	29,000	3,560.00	103,240,000
宇部興産	48,500	1,807.00	87,639,500
積水樹脂	17,300	2,209.00	38,215,700
タキロンシーアイ	20,900	702.00	14,671,800
旭有機材	5,400	1,405.00	7,587,000
ニチバン	5,100	1,500.00	7,650,000
リケンテクノス	24,600	413.00	10,159,800
大倉工業	4,500	1,479.00	6,655,500
積水化成成品工業	13,000	552.00	7,176,000
群栄化学工業	2,200	2,576.00	5,667,200
タイガースポリマー	5,200	465.00	2,418,000
ミライアル	3,400	1,080.00	3,672,000
ダイキアクシス	3,500	731.00	2,558,500
ダイキョーニシカワ	20,200	473.00	9,554,600
竹本容器	3,500	701.00	2,453,500
森六ホールディングス	5,100	1,665.00	8,491,500
日本化薬	59,600	1,094.00	65,202,400
カーリットホールディングス	10,600	502.00	5,321,200
E P S ホールディングス	12,800	1,030.00	13,184,000
ソルクシーズ	4,300	709.00	3,048,700
レグス	2,500	851.00	2,127,500
プレステージ・インターナショナル	35,500	857.00	30,423,500
フェイス	3,500	640.00	2,240,000
プロトコーポレーション	8,800	982.00	8,641,600

ハイマックス	1,100	2,028.00	2,230,800
アミューズ	5,100	2,258.00	11,515,800
野村総合研究所	136,900	2,914.00	398,926,600
ドリームインキュベータ	2,900	1,250.00	3,625,000
サイバネットシステム	7,100	657.00	4,664,700
クイック	5,800	1,135.00	6,583,000
T A C	5,900	198.00	1,168,200
C Eホールディングス	5,700	533.00	3,038,100
ケネディクス	88,000	485.00	42,680,000
日本システム技術	1,600	1,664.00	2,662,400
電通グループ	97,000	2,521.00	244,537,000
インテージホールディングス	12,100	896.00	10,841,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	565.00	2,090,500
東邦システムサイエンス	2,600	914.00	2,376,400
ぴあ	2,800	3,075.00	8,610,000
イオンファンタジー	3,700	1,451.00	5,368,700
ソースネクスト	46,300	280.00	12,964,000
シーティーエス	10,700	871.00	9,319,700
ネクシィーズグループ	3,100	918.00	2,845,800
インフォコム	10,600	3,235.00	34,291,000
メディカルシステムネットワーク	9,600	496.00	4,761,600
日本精化	7,800	1,460.00	11,388,000
扶桑化学工業	9,800	4,200.00	41,160,000
トリケミカル研究所	2,200	11,980.00	26,356,000
HEROZ	1,400	3,425.00	4,795,000
ラクスル	7,700	3,375.00	25,987,500
F I G	10,900	271.00	2,953,900
システムサポート	1,300	1,928.00	2,506,400
A D E K A	44,300	1,468.00	65,032,400
日油	36,300	3,900.00	141,570,000
ミヨシ油脂	4,000	1,071.00	4,284,000
新日本理化	16,500	163.00	2,689,500
ハリマ化成グループ	8,000	947.00	7,576,000
イーソル	3,500	1,106.00	3,871,000
アルテリア・ネットワークス	10,800	1,980.00	21,384,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,900	1,062.00	2,017,800
花王	235,600	8,512.00	2,005,427,200
第一工業製薬	3,600	5,110.00	18,396,000
石原ケミカル	2,700	1,948.00	5,259,600
日華化学	3,300	803.00	2,649,900
ニイタカ	1,600	4,240.00	6,784,000
三洋化成工業	5,700	4,660.00	26,562,000
武田薬品工業	818,700	3,722.00	3,047,201,400
アステラス製薬	853,100	1,744.00	1,487,806,400
大日本住友製薬	72,900	1,395.00	101,695,500
塩野義製薬	123,800	6,247.00	773,378,600
わかもと製薬	11,900	273.00	3,248,700
あすか製薬	11,300	1,200.00	13,560,000
日本新薬	25,700	8,000.00	205,600,000

Bioフェルミン製薬	1,700	2,309.00	3,925,300	
中外製薬	307,800	5,400.00	1,662,120,000	
科研製薬	16,800	5,240.00	88,032,000	
エーザイ	117,900	8,639.00	1,018,538,100	
理研ビタミン	9,200	2,253.00	20,727,600	
ロート製薬	50,500	3,470.00	175,235,000	
小野薬品工業	226,000	2,913.00	658,338,000	
久光製薬	26,000	5,060.00	131,560,000	
有機合成薬品工業	7,600	344.00	2,614,400	
持田製薬	13,600	4,010.00	54,536,000	
参天製薬	183,300	1,878.00	344,237,400	
扶桑薬品工業	3,500	2,330.00	8,155,000	
日本ケミファ	1,300	2,412.00	3,135,600	
ツムラ	30,500	2,817.00	85,918,500	
日医工	28,000	1,243.00	34,804,000	
テルモ	278,500	3,926.00	1,093,391,000	
H.U.グループホールディングス	26,300	2,550.00	67,065,000	
キッセイ薬品工業	17,400	2,459.00	42,786,600	
生化学工業	19,000	1,082.00	20,558,000	
栄研化学	17,400	1,662.00	28,918,800	
日水製薬	4,300	1,093.00	4,699,900	
鳥居薬品	6,100	3,155.00	19,245,500	
JCRファーマ	6,900	10,710.00	73,899,000	
東和薬品	12,600	1,911.00	24,078,600	
富士製薬工業	6,800	1,154.00	7,847,200	
沢井製薬	20,300	5,280.00	107,184,000	
ゼリア新薬工業	17,800	1,931.00	34,371,800	
第一三共	281,600	8,576.00	2,415,001,600	
キョーリン製薬ホールディングス	21,800	2,096.00	45,692,800	
大幸薬品	12,000	2,284.00	27,408,000	
ダイト	5,900	3,240.00	19,116,000	
大塚ホールディングス	187,500	4,591.00	860,812,500	
大正製薬ホールディングス	20,800	6,330.00	131,664,000	
ペプチドリーム	50,000	4,665.00	233,250,000	
大日本塗料	11,000	896.00	9,856,000	
日本ペイントホールディングス	79,500	8,020.00	637,590,000	
関西ペイント	108,300	2,191.00	237,285,300	
神東塗料	8,100	172.00	1,393,200	
中国塗料	27,500	833.00	22,907,500	
日本特殊塗料	7,300	989.00	7,219,700	
藤倉化成	13,100	530.00	6,943,000	
太陽ホールディングス	7,100	5,190.00	36,849,000	
DIC	40,600	2,757.00	111,934,200	
サカティンクス	21,100	1,057.00	22,302,700	
東洋インキSCホールディングス	20,300	2,085.00	42,325,500	
T&K TOKA	7,500	827.00	6,202,500	
アルプス技研	8,400	1,873.00	15,733,200	
サニックス	16,900	268.00	4,529,200	
ダイオーズ	1,800	992.00	1,785,600	
日本空調サービス	10,000	747.00	7,470,000	

オリエンタルランド	100,000	14,000.00	1,400,000,000	
フォーカスシステムズ	6,200	826.00	5,121,200	
ダスキン	23,400	2,697.00	63,109,800	
パーク24	52,100	1,738.00	90,549,800	
明光ネットワークジャパン	11,500	729.00	8,383,500	
ファルコホールディングス	5,200	1,524.00	7,924,800	
クレスコ	5,900	1,358.00	8,012,200	
フジ・メディア・ホールディングス	92,800	989.00	91,779,200	
秀英予備校	2,000	421.00	842,000	
田谷	1,800	517.00	930,600	
ラウンドワン	26,400	719.00	18,981,600	
リゾートトラスト	43,000	1,339.00	57,577,000	
オービック	33,500	19,430.00	650,905,000	
ジャストシステム	15,700	7,890.00	123,873,000	
TDCソフト	8,600	911.00	7,834,600	
Zホールディングス	1,326,300	535.00	709,570,500	
ビー・エム・エル	12,100	2,793.00	33,795,300	
ワタベウェディング	1,800	278.00	500,400	
トレンドマイクロ	43,000	6,300.00	270,900,000	
りらいあコミュニケーションズ	17,200	1,103.00	18,971,600	
IDホールディングス	3,800	1,386.00	5,266,800	
リソー教育	43,200	295.00	12,744,000	
日本オラクル	19,600	13,450.00	263,620,000	
早稲田アカデミー	3,300	943.00	3,111,900	
アルファシステムズ	3,000	3,835.00	11,505,000	
フューチャー	11,800	1,731.00	20,425,800	
CAC Holdings	6,400	1,195.00	7,648,000	
S Bテクノロジー	3,500	3,645.00	12,757,500	
トーセ	2,700	848.00	2,289,600	
ユー・エス・エス	105,300	1,707.00	179,747,100	
オービックビジネスコンサルタント	9,900	5,980.00	59,202,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	44,100	4,245.00	187,204,500	
アイティフォー	11,900	763.00	9,079,700	
東京個別指導学院	3,500	465.00	1,627,500	
東計電算	1,500	4,165.00	6,247,500	
サイバーエージェント	57,900	5,960.00	345,084,000	
楽天	438,400	1,000.00	438,400,000	
エクスネット	1,600	976.00	1,561,600	
クリーク・アンド・リバー社	4,800	1,252.00	6,009,600	
テー・オー・ダブリュー	15,300	317.00	4,850,100	
大塚商会	52,300	5,720.00	299,156,000	
サイボウズ	11,400	3,560.00	40,584,000	
ソフトブレーン	5,800	419.00	2,430,200	
山田コンサルティンググループ	4,600	1,220.00	5,612,000	
セントラルスポーツ	3,500	2,139.00	7,486,500	
パラカ	2,600	1,597.00	4,152,200	
電通国際情報サービス	6,000	5,020.00	30,120,000	
ACCESS	9,100	943.00	8,581,300	
デジタルガレージ	17,400	3,705.00	64,467,000	
イーエムシステムズ	13,700	938.00	12,850,600	

ウェザーニューズ	3,300	3,535.00	11,665,500	
C I J	6,800	797.00	5,419,600	
ビジネスエンジニアリング	1,100	2,649.00	2,913,900	
日本エンタープライズ	10,300	266.00	2,739,800	
WOWOW	4,500	2,441.00	10,984,500	
スカラ	6,700	674.00	4,515,800	
インテリジェント ウェイブ	4,400	798.00	3,511,200	
フルキャストホールディングス	9,600	1,343.00	12,892,800	
エン・ジャパン	16,700	2,573.00	42,969,100	
富士フイルムホールディングス	188,700	4,636.00	874,813,200	
コニカミノルタ	215,100	373.00	80,232,300	
資生堂	195,600	6,762.00	1,322,647,200	
ライオン	128,000	2,664.00	340,992,000	
高砂香料工業	6,100	2,130.00	12,993,000	
マンダム	22,100	1,902.00	42,034,200	
ミルボン	13,200	4,885.00	64,482,000	
ファンケル	39,800	3,125.00	124,375,000	
コーセー	18,500	12,090.00	223,665,000	
コタ	5,600	1,184.00	6,630,400	
シーボン	1,400	1,906.00	2,668,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	42,000	1,783.00	74,886,000	
ノエビアホールディングス	8,300	4,535.00	37,640,500	
アジュバンコスメジャパン	2,300	948.00	2,180,400	
エステー	6,300	1,694.00	10,672,200	
アグロ カネショウ	3,100	1,312.00	4,067,200	
コニシ	16,200	1,458.00	23,619,600	
長谷川香料	17,000	2,363.00	40,171,000	
星光PMC	5,700	724.00	4,126,800	
小林製薬	27,600	9,370.00	258,612,000	
荒川化学工業	8,900	1,217.00	10,831,300	
メック	6,800	2,070.00	14,076,000	
日本高純度化学	2,800	2,593.00	7,260,400	
タカラパイオ	25,800	3,000.00	77,400,000	
J C U	12,000	3,280.00	39,360,000	
新田ゼラチン	6,300	659.00	4,151,700	
O A T アグリオ	1,800	1,098.00	1,976,400	
デクセリアルズ	25,500	823.00	20,986,500	
アース製薬	7,500	6,910.00	51,825,000	
北興化学工業	10,200	590.00	6,018,000	
大成ラミック	3,300	2,721.00	8,979,300	
クミアイ化学工業	40,700	1,016.00	41,351,200	
日本農薬	17,700	498.00	8,814,600	
富士興産	3,000	427.00	1,281,000	
ニチレキ	11,800	1,619.00	19,104,200	
ユシロ化学工業	5,400	1,290.00	6,966,000	
ピーピー・カストロール	3,500	1,065.00	3,727,500	
富士石油	27,100	158.00	4,281,800	
MORESCO	3,700	1,024.00	3,788,800	
出光興産	109,200	2,287.00	249,740,400	
ENEOSホールディングス	1,479,800	383.50	567,503,300	

コスモエネルギーホールディングス	28,500	1,531.00	43,633,500
横浜ゴム	57,000	1,515.00	86,355,000
TOYO TIRE	56,600	1,437.00	81,334,200
ブリヂストン	283,400	3,471.00	983,681,400
住友ゴム工業	88,100	990.00	87,219,000
藤倉コンポジット	8,400	371.00	3,116,400
オカモト	5,900	3,990.00	23,541,000
アキレス	6,900	1,981.00	13,668,900
フコク	4,400	655.00	2,882,000
ニッタ	11,100	2,379.00	26,406,900
クリエートメディック	3,300	968.00	3,194,400
住友理工	18,900	600.00	11,340,000
三ツ星ベルト	13,000	1,751.00	22,763,000
バンドー化学	17,300	650.00	11,245,000
A G C	97,300	3,105.00	302,116,500
日本板硝子	47,300	381.00	18,021,300
石塚硝子	1,900	1,781.00	3,383,900
有沢製作所	15,800	833.00	13,161,400
日本山村硝子	4,100	859.00	3,521,900
日本電気硝子	39,600	1,702.00	67,399,200
オハラ	4,000	1,103.00	4,412,000
住友大阪セメント	18,600	3,740.00	69,564,000
太平洋セメント	62,200	2,394.00	148,906,800
リソルホールディングス	1,000	3,345.00	3,345,000
日本ヒューム	10,000	777.00	7,770,000
日本コンクリート工業	21,500	270.00	5,805,000
三谷セキサン	4,500	5,010.00	22,545,000
アジアパイルホールディングス	14,100	469.00	6,612,900
東海カーボン	103,100	990.00	102,069,000
日本カーボン	5,100	3,505.00	17,875,500
東洋炭素	5,700	1,717.00	9,786,900
ノリタケカンパニーリミテド	5,400	3,380.00	18,252,000
TOTO	70,300	4,280.00	300,884,000
日本碍子	118,200	1,439.00	170,089,800
日本特殊陶業	74,900	1,477.00	110,627,300
ダントーホールディングス	7,900	89.00	703,100
MARUWA	3,800	8,040.00	30,552,000
品川リフラクトリーズ	2,600	2,144.00	5,574,400
黒崎播磨	2,000	3,575.00	7,150,000
ヨータイ	8,000	708.00	5,664,000
イソライト工業	5,200	420.00	2,184,000
東京窯業	12,100	286.00	3,460,600
ニッカトー	4,500	682.00	3,069,000
フジインコーポレーテッド	8,800	3,700.00	32,560,000
クニミネ工業	4,100	941.00	3,858,100
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,047.00	1,779,900
ニチアス	27,000	2,308.00	62,316,000
日本製鉄	435,200	1,030.00	448,256,000
神戸製鋼所	177,700	373.00	66,282,100
中山製鋼所	13,200	353.00	4,659,600

合同製鐵	5,300	1,818.00	9,635,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	262,500	798.00	209,475,000
東京製鐵	47,500	633.00	30,067,500
共英製鋼	11,000	1,278.00	14,058,000
大和工業	20,700	2,136.00	44,215,200
東京鐵鋼	4,100	1,491.00	6,113,100
大阪製鐵	5,100	1,228.00	6,262,800
淀川製鋼所	13,100	1,826.00	23,920,600
丸一鋼管	31,500	2,687.00	84,640,500
モリ工業	3,000	2,203.00	6,609,000
大同特殊鋼	15,900	3,420.00	54,378,000
日本高周波鋼業	3,900	346.00	1,349,400
日本冶金工業	8,100	1,546.00	12,522,600
山陽特殊製鋼	6,600	862.00	5,689,200
愛知製鋼	5,400	3,040.00	16,416,000
日立金属	104,900	1,323.00	138,782,700
日本金属	2,300	603.00	1,386,900
大平洋金属	6,600	1,570.00	10,362,000
新日本電工	63,400	165.00	10,461,000
栗本鐵工所	4,800	1,657.00	7,953,600
虹 技	1,400	1,160.00	1,624,000
日本鑄鉄管	1,000	1,288.00	1,288,000
日本製鋼所	29,600	1,556.00	46,057,600
三菱製鋼	7,300	627.00	4,577,100
日亜鋼業	14,200	281.00	3,990,200
日本精線	1,600	3,360.00	5,376,000
エンビプロ・ホールディングス	4,300	533.00	2,291,900
大紀アルミニウム工業所	15,900	537.00	8,538,300
日本軽金属ホールディングス	246,400	188.00	46,323,200
三井金属鉱業	26,300	2,348.00	61,752,400
東邦亜鉛	5,100	1,543.00	7,869,300
三菱マテリアル	64,200	2,327.00	149,393,400
住友金属鉱山	124,500	3,216.00	400,392,000
DOWAホールディングス	24,700	3,335.00	82,374,500
古河機械金属	17,200	1,107.00	19,040,400
エス・サイエンス	44,900	45.00	2,020,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,200	931.00	9,496,200
東邦チタニウム	17,500	653.00	11,427,500
UACJ	14,700	1,886.00	27,724,200
CKサンエツ	2,100	2,994.00	6,287,400
古河電気工業	30,200	2,628.00	79,365,600
住友電気工業	363,500	1,287.50	468,006,250
フジクラ	117,800	316.00	37,224,800
昭和電線ホールディングス	11,400	1,142.00	13,018,800
東京特殊電線	1,500	2,145.00	3,217,500
タツタ電線	19,600	536.00	10,505,600
カナレ電気	1,700	1,680.00	2,856,000
平河ヒューテック	3,900	972.00	3,790,800
リョービ	12,000	1,137.00	13,644,000

アーレスティ	12,800	342.00	4,377,600
アサヒホールディングス	17,100	2,789.00	47,691,900
東洋製罐グループホールディングス	61,900	1,186.00	73,413,400
ホッカンホールディングス	5,300	1,718.00	9,105,400
コロナ	5,300	1,026.00	5,437,800
横河ブリッジホールディングス	18,200	2,103.00	38,274,600
OSJBホールディングス	49,000	230.00	11,270,000
駒井ハルテック	1,900	1,387.00	2,635,300
高田機工	900	2,401.00	2,160,900
三和ホールディングス	91,800	929.00	85,282,200
文化シャッター	28,800	762.00	21,945,600
三協立山	12,600	930.00	11,718,000
アルインコ	7,100	913.00	6,482,300
東洋シャッター	2,500	652.00	1,630,000
LIXILグループ	143,600	1,519.00	218,128,400
日本フィルコン	7,400	477.00	3,529,800
ノーリツ	20,200	1,356.00	27,391,200
長府製作所	9,900	2,206.00	21,839,400
リンナイ	18,900	8,940.00	168,966,000
ユニプレス	19,000	887.00	16,853,000
ダイニチ工業	5,300	705.00	3,736,500
日東精工	13,700	439.00	6,014,300
三洋工業	1,400	1,948.00	2,727,200
岡部	19,700	812.00	15,996,400
ジーテクト	12,000	969.00	11,628,000
東プレ	18,200	1,148.00	20,893,600
高周波熱錬	18,700	505.00	9,443,500
東京製綱	7,100	574.00	4,075,400
サンコール	5,400	403.00	2,176,200
モリテックスチール	7,900	269.00	2,125,100
パイオラックス	14,300	1,606.00	22,965,800
エイチワン	9,800	548.00	5,370,400
日本発条	104,300	669.00	69,776,700
中央発條	1,100	2,685.00	2,953,500
アドパネクス	1,400	1,383.00	1,936,200
三浦工業	42,200	4,300.00	181,460,000
タクマ	33,000	1,518.00	50,094,000
テクノプロ・ホールディングス	18,800	5,870.00	110,356,000
アトラ	2,600	223.00	579,800
インターワークス	1,900	345.00	655,500
アイ・アールジャパンホールディングス	3,900	11,230.00	43,797,000
KeepPer 技研	3,500	1,677.00	5,869,500
ファーストロジック	2,000	623.00	1,246,000
三機サービス	1,900	968.00	1,839,200
Gunosy	5,900	942.00	5,557,800
デザインワン・ジャパン	2,300	254.00	584,200
イー・ガーディアン	4,300	2,954.00	12,702,200
リブセンス	6,300	290.00	1,827,000
ジャパンマテリアル	29,000	1,725.00	50,025,000

ベクトル	12,000	866.00	10,392,000
ウチヤマホールディングス	4,700	300.00	1,410,000
チャーム・ケア・コーポレーション	8,100	770.00	6,237,000
ライクキッズ	1,700	1,003.00	1,705,100
キャリアリンク	3,100	768.00	2,380,800
I B J	6,700	647.00	4,334,900
アサンテ	4,000	1,443.00	5,772,000
N・フィールド	6,700	507.00	3,396,900
パリュールHR	3,800	1,395.00	5,301,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,600	4,000.00	30,400,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	2,345.00	8,676,500
E R Iホールディングス	2,800	632.00	1,769,600
アビスト	1,600	2,589.00	4,142,400
シグマクシス	6,500	1,558.00	10,127,000
ウィルグループ	6,300	631.00	3,975,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,400	287.00	3,845,800
リクルートホールディングス	673,700	3,726.00	2,510,206,200
エラン	5,500	1,707.00	9,388,500
ツガミ	20,400	935.00	19,074,000
オークマ	11,400	4,605.00	52,497,000
芝浦機械	11,100	2,115.00	23,476,500
アマダ	120,500	800.00	96,400,000
アイダエンジニアリング	25,400	741.00	18,821,400
滝澤鉄工所	3,100	990.00	3,069,000
F U J I	41,900	1,914.00	80,196,600
牧野フライス製作所	11,500	3,315.00	38,122,500
オーエスジー	45,100	1,658.00	74,775,800
ダイジェット工業	1,100	1,367.00	1,503,700
旭ダイヤモンド工業	25,700	464.00	11,924,800
D M G 森精機	61,700	1,306.00	80,580,200
ソディック	22,900	829.00	18,984,100
ディスコ	13,200	27,650.00	364,980,000
日東工器	5,300	1,918.00	10,165,400
日進工具	3,900	2,517.00	9,816,300
パンチ工業	9,100	417.00	3,794,700
富士ダイス	4,400	656.00	2,886,400
土木管理総合試験所	4,400	387.00	1,702,800
ネットマーケティング	2,800	608.00	1,702,400
日本郵政	770,000	776.20	597,674,000
ベルシステム24ホールディングス	15,900	1,691.00	26,886,900
鎌倉新書	7,200	1,009.00	7,264,800
S M N	1,600	1,063.00	1,700,800
一蔵	1,300	381.00	495,300
L I T A L I C O	3,300	2,181.00	7,197,300
グローバルキッズCOMPANY	1,500	597.00	895,500
エアトリ	4,400	1,228.00	5,403,200
アトラエ	2,500	3,035.00	7,587,500
ストライク	3,500	5,060.00	17,710,000
ソラスト	26,000	1,037.00	26,962,000

セラク	3,000	1,124.00	3,372,000	
インソース	4,000	2,680.00	10,720,000	
豊田自動織機	79,500	5,670.00	450,765,000	
豊和工業	5,400	768.00	4,147,200	
OKK	4,200	370.00	1,554,000	
石川製作所	2,500	1,561.00	3,902,500	
東洋機械金属	7,100	404.00	2,868,400	
津田駒工業	1,900	855.00	1,624,500	
エンシュウ	2,500	896.00	2,240,000	
島精機製作所	15,300	1,369.00	20,945,700	
オプトラン	10,900	2,495.00	27,195,500	
NCホールディングス	3,100	554.00	1,717,400	
イワキ	4,600	943.00	4,337,800	
フリー	9,800	969.00	9,496,200	
ヤマシンフィルタ	21,300	1,031.00	21,960,300	
日阪製作所	12,000	751.00	9,012,000	
やまびこ	18,800	951.00	17,878,800	
平田機工	4,600	5,930.00	27,278,000	
ペガサスミシン製造	10,000	312.00	3,120,000	
マルマエ	3,700	1,181.00	4,369,700	
タツモ	4,500	1,888.00	8,496,000	
ナブテスコ	57,400	3,415.00	196,021,000	
三井海洋開発	10,400	1,538.00	15,995,200	
レオン自動機	9,600	1,241.00	11,913,600	
S M C	30,800	56,870.00	1,751,596,000	
ホソカワミクロン	3,400	5,440.00	18,496,000	
ユニオンツール	3,600	2,659.00	9,572,400	
オイレス工業	12,600	1,419.00	17,879,400	
日精エー・エス・ビー機械	2,900	3,095.00	8,975,500	
サトーホールディングス	13,900	2,452.00	34,082,800	
技研製作所	8,600	4,610.00	39,646,000	
日本エアテック	3,100	1,246.00	3,862,600	
カワタ	2,900	742.00	2,151,800	
日精樹脂工業	8,200	810.00	6,642,000	
オカダアイヨン	3,300	942.00	3,108,600	
ワイエイシイホールディングス	4,400	715.00	3,146,000	
小松製作所	445,700	2,199.00	980,094,300	
住友重機械工業	56,300	2,289.00	128,870,700	
日立建機	39,500	3,130.00	123,635,000	
日工	13,500	622.00	8,397,000	
巴工業	4,200	1,852.00	7,778,400	
井関農機	9,800	1,147.00	11,240,600	
T O W A	10,000	1,410.00	14,100,000	
丸山製作所	2,200	1,152.00	2,534,400	
北川鉄工所	4,400	1,539.00	6,771,600	
シンニッタン	15,700	215.00	3,375,500	
ローツェ	4,400	5,840.00	25,696,000	
タカキタ	3,500	600.00	2,100,000	
クボタ	522,000	1,582.50	826,065,000	
荏原実業	2,600	2,860.00	7,436,000	

東洋エンジニアリング	13,100	353.00	4,624,300
三菱化工機	3,500	1,836.00	6,426,000
月島機械	18,100	1,161.00	21,014,100
帝国電機製作所	8,200	1,238.00	10,151,600
東京機械製作所	4,300	278.00	1,195,400
新東工業	23,300	770.00	17,941,000
澁谷工業	8,600	2,910.00	25,026,000
アイチコーポレーション	16,900	787.00	13,300,300
小森コーポレーション	24,800	692.00	17,161,600
鶴見製作所	7,600	1,824.00	13,862,400
住友精密工業	1,400	2,159.00	3,022,600
日本ギア工業	3,500	279.00	976,500
酒井重工業	1,900	2,240.00	4,256,000
荏原製作所	40,700	2,600.00	105,820,000
石井鐵工所	1,300	2,495.00	3,243,500
西島製作所	9,900	866.00	8,573,400
北越工業	10,200	1,091.00	11,128,200
ダイキン工業	125,400	18,770.00	2,353,758,000
オルガノ	3,500	5,640.00	19,740,000
トーヨーカネツ	4,400	2,072.00	9,116,800
栗田工業	53,200	3,015.00	160,398,000
椿本チエイン	14,000	2,619.00	36,666,000
大同工業	4,600	632.00	2,907,200
日機装	29,600	952.00	28,179,200
木村化工機	8,400	411.00	3,452,400
レイズネクスト	16,500	1,259.00	20,773,500
アネスト岩田	15,400	812.00	12,504,800
ダイフク	50,300	10,110.00	508,533,000
サムコ	2,500	2,971.00	7,427,500
加藤製作所	5,400	1,216.00	6,566,400
油研工業	1,700	1,501.00	2,551,700
タダノ	47,600	892.00	42,459,200
フジテック	35,800	1,959.00	70,132,200
C K D	27,100	2,178.00	59,023,800
キトー	7,500	1,220.00	9,150,000
平和	27,300	1,809.00	49,385,700
理想科学工業	8,700	1,376.00	11,971,200
SANKYO	21,900	2,755.00	60,334,500
日本金銭機械	11,100	567.00	6,293,700
マースグループホールディングス	6,100	1,640.00	10,004,000
フクシマガリレイ	6,000	3,365.00	20,190,000
オーイズミ	4,400	393.00	1,729,200
ダイコク電機	4,500	1,195.00	5,377,500
竹内製作所	16,500	1,839.00	30,343,500
アマノ	25,800	2,276.00	58,720,800
JUKI	13,900	519.00	7,214,100
サンデンホールディングス	13,100	266.00	3,484,600
蛇の目ミシン工業	9,000	435.00	3,915,000
ブラザー工業	120,100	1,899.00	228,069,900
マックス	15,000	1,535.00	23,025,000

モリタホールディングス	17,100	1,815.00	31,036,500
グローリー	25,100	2,503.00	62,825,300
新晃工業	9,200	1,435.00	13,202,000
大和冷機工業	14,200	974.00	13,830,800
セガサミーホールディングス	97,500	1,305.00	127,237,500
日本ピストンリング	3,500	1,247.00	4,364,500
リケン	4,500	2,800.00	12,600,000
T P R	13,200	1,475.00	19,470,000
ツバキ・ナカシマ	20,500	827.00	16,953,500
ホシザキ	28,800	8,920.00	256,896,000
大豊工業	8,100	540.00	4,374,000
日本精工	185,100	782.00	144,748,200
NTN	227,700	211.00	48,044,700
ジェイテクト	94,100	810.00	76,221,000
不二越	9,200	3,430.00	31,556,000
ミネベアミツミ	182,800	1,890.00	345,492,000
日本トムソン	29,300	336.00	9,844,800
T H K	57,300	2,756.00	157,918,800
ユーシン精機	7,600	715.00	5,434,000
前澤給装工業	3,700	2,110.00	7,807,000
イーグル工業	12,100	706.00	8,542,600
前澤工業	6,800	388.00	2,638,400
日本ピラー工業	10,000	1,479.00	14,790,000
キッツ	39,900	680.00	27,132,000
日立製作所	472,800	3,409.00	1,611,775,200
三菱電機	983,800	1,387.00	1,364,530,600
富士電機	59,300	2,872.00	170,309,600
東洋電機製造	3,600	1,189.00	4,280,400
安川電機	105,900	4,095.00	433,660,500
シンフォニアテクノロジー	12,800	1,048.00	13,414,400
明電舎	18,100	1,633.00	29,557,300
オリジン	2,700	1,281.00	3,458,700
山洋電気	4,700	4,845.00	22,771,500
デンヨー	8,400	2,003.00	16,825,200
ベイカレント・コンサルティング	5,700	9,030.00	51,471,000
Orchestra Holdings	2,000	1,561.00	3,122,000
アイモバイル	3,000	766.00	2,298,000
キャリアインデックス	4,100	521.00	2,136,100
MS - Japan	3,100	783.00	2,427,300
船場	1,600	973.00	1,556,800
グレイステクノロジー	4,400	6,120.00	26,928,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,900	3,620.00	35,838,000
フルテック	1,400	1,298.00	1,817,200
グリーンズ	2,500	466.00	1,165,000
ツナググループ・ホールディングス	1,400	418.00	585,200
GAMEWITH	2,300	566.00	1,301,800
ソウルドアウト	1,500	2,600.00	3,900,000
MS&Consulting	1,600	582.00	931,200

日総工産	6,500	643.00	4,179,500
キュービーネットホールディングス	4,000	1,862.00	7,448,000
RPAホールディングス	5,400	695.00	3,753,000
三櫻工業	12,700	658.00	8,356,600
マキタ	128,300	4,055.00	520,256,500
東芝テック	12,300	4,295.00	52,828,500
芝浦メカトロニクス	1,700	2,815.00	4,785,500
マブチモーター	27,300	3,345.00	91,318,500
日本電産	236,900	7,091.00	1,679,857,900
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,100	385.00	2,348,500
トレックス・セミコンダクター	5,600	1,259.00	7,050,400
東光高岳	5,400	1,006.00	5,432,400
ダブル・スコープ	15,900	714.00	11,352,600
宮越ホールディングス	3,700	690.00	2,553,000
ダイヘン	10,800	4,115.00	44,442,000
ヤーマン	16,200	964.00	15,616,800
JVCケンウッド	80,600	157.00	12,654,200
ミマキエンジニアリング	8,800	389.00	3,423,200
第一精工	4,100	2,019.00	8,277,900
日新電機	23,000	1,049.00	24,127,000
大崎電気工業	19,800	517.00	10,236,600
オムロン	88,200	7,370.00	650,034,000
日東工業	14,300	1,832.00	26,197,600
I D E C	14,200	1,656.00	23,515,200
正興電機製作所	2,400	960.00	2,304,000
不二電機工業	1,400	1,338.00	1,873,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32,900	1,834.00	60,338,600
サクサホールディングス	2,400	1,513.00	3,631,200
メルコホールディングス	3,400	3,290.00	11,186,000
テクノメディカ	2,300	1,664.00	3,827,200
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,700	580.00	986,000
日本電気	119,300	5,770.00	688,361,000
富士通	94,800	13,290.00	1,259,892,000
沖電気工業	39,800	1,063.00	42,307,400
岩崎通信機	4,400	830.00	3,652,000
電気興業	4,700	2,483.00	11,670,100
サンケン電気	10,700	2,067.00	22,116,900
ナカヨ	1,900	1,335.00	2,536,500
アイホン	5,400	1,460.00	7,884,000
ルネサスエレクトロニクス	470,500	619.00	291,239,500
セイコーエプソン	122,100	1,243.00	151,770,300
ワコム	66,200	581.00	38,462,200
アルバック	18,200	3,325.00	60,515,000
アクセル	4,300	815.00	3,504,500
E I Z O	7,600	4,170.00	31,692,000
ジャパンディスプレイ	286,300	44.00	12,597,200
日本信号	24,900	1,094.00	27,240,600
京三製作所	23,000	567.00	13,041,000
能美防災	13,000	2,099.00	27,287,000

ホーチキ	7,200	1,246.00	8,971,200	
星和電機	4,900	611.00	2,993,900	
エレコム	10,900	5,360.00	58,424,000	
パナソニック	1,124,000	995.70	1,119,166,800	
シャープ	113,900	1,149.00	130,871,100	
アンリツ	63,400	2,519.00	159,704,600	
富士通ゼネラル	26,800	2,418.00	64,802,400	
ソニー	616,400	8,100.00	4,992,840,000	
T D K	47,600	10,860.00	516,936,000	
帝国通信工業	4,400	1,150.00	5,060,000	
タムラ製作所	33,600	441.00	14,817,600	
アルプスアルパイン	87,400	1,416.00	123,758,400	
池上通信機	3,200	860.00	2,752,000	
日本電波工業	9,000	318.00	2,862,000	
鈴木	4,800	675.00	3,240,000	
日本トリム	1,400	3,295.00	4,613,000	
ローランド ディー . ジー .	5,400	1,181.00	6,377,400	
フォスター電機	10,400	1,140.00	11,856,000	
S M K	2,600	2,493.00	6,481,800	
ヨコオ	6,400	2,632.00	16,844,800	
ティアック	7,400	134.00	991,600	
ホシデン	27,100	946.00	25,636,600	
ヒロセ電機	15,200	11,910.00	181,032,000	
日本航空電子工業	22,700	1,495.00	33,936,500	
T O A	10,700	756.00	8,089,200	
マクセルホールディングス	21,200	940.00	19,928,000	
古野電気	12,700	1,007.00	12,788,900	
ユニデンホールディングス	2,800	1,788.00	5,006,400	
スミダコーポレーション	7,600	720.00	5,472,000	
アイコム	5,400	3,000.00	16,200,000	
リオン	4,200	2,150.00	9,030,000	
本多通信工業	8,800	419.00	3,687,200	
船井電機	10,000	508.00	5,080,000	
横河電機	90,300	1,657.00	149,627,100	
新電元工業	3,500	2,076.00	7,266,000	
アズビル	62,100	3,450.00	214,245,000	
東亜ディーケーケー	4,800	796.00	3,820,800	
日本光電工業	40,600	3,575.00	145,145,000	
チノー	3,500	1,430.00	5,005,000	
共和電業	10,400	426.00	4,430,400	
日本電子材料	4,000	1,545.00	6,180,000	
堀場製作所	19,500	5,860.00	114,270,000	
アドバンテスト	73,200	6,990.00	511,668,000	
小野測器	4,300	484.00	2,081,200	
エスベック	8,700	1,873.00	16,295,100	
キーエンス	89,200	45,500.00	4,058,600,000	
日置電機	5,100	3,120.00	15,912,000	
シスメックス	70,400	8,022.00	564,748,800	
日本マイクロニクス	17,100	1,188.00	20,314,800	
メガチップス	9,200	2,110.00	19,412,000	

OBARA GROUP	5,100	3,465.00	17,671,500
IMAGICA GROUP	8,400	378.00	3,175,200
澤藤電機	1,200	1,646.00	1,975,200
デンソー	216,600	4,268.00	924,448,800
原田工業	4,700	892.00	4,192,400
コーセル	13,200	854.00	11,272,800
イリソ電子工業	8,200	3,180.00	26,076,000
オブテックスグループ	16,200	1,215.00	19,683,000
千代田インテグレ	4,500	1,678.00	7,551,000
アイ・オー・データ機器	3,300	1,011.00	3,336,300
レーザーテック	43,200	11,550.00	498,960,000
スタンレー電気	69,200	2,624.00	181,580,800
岩崎電気	3,900	1,893.00	7,382,700
ウシオ電機	54,500	1,349.00	73,520,500
岡谷電機産業	8,000	300.00	2,400,000
ヘリオス テクノ ホールディング	9,600	316.00	3,033,600
エノモト	3,000	1,027.00	3,081,000
日本セラミック	10,100	2,182.00	22,038,200
遠藤照明	4,800	606.00	2,908,800
古河電池	7,100	1,146.00	8,136,600
双信電機	4,900	406.00	1,989,400
山一電機	7,200	1,386.00	9,979,200
図研	6,400	3,040.00	19,456,000
日本電子	19,400	3,090.00	59,946,000
カシオ計算機	87,100	1,846.00	160,786,600
ファナック	92,500	20,365.00	1,883,762,500
日本シイエムケイ	23,300	396.00	9,226,800
エンプラス	5,000	2,305.00	11,525,000
大真空	3,700	2,324.00	8,598,800
ローム	43,700	7,150.00	312,455,000
浜松ホトニクス	70,600	4,865.00	343,469,000
三井ハイテック	11,000	1,708.00	18,788,000
新光電気工業	33,000	1,737.00	57,321,000
京セラ	138,400	5,837.00	807,840,800
協栄産業	1,100	1,188.00	1,306,800
太陽誘電	43,800	3,470.00	151,986,000
村田製作所	289,100	6,561.00	1,896,785,100
双葉電子工業	15,700	988.00	15,511,600
日東電工	67,900	6,000.00	407,400,000
北陸電気工業	4,100	848.00	3,476,800
東海理化電機製作所	25,700	1,516.00	38,961,200
ニチコン	33,600	719.00	24,158,400
日本ケミコン	7,500	1,932.00	14,490,000
KOA	15,100	957.00	14,450,700
三井E&Sホールディングス	35,800	427.00	15,286,600
日立造船	78,000	383.00	29,874,000
三菱重工業	164,800	2,598.00	428,150,400
川崎重工業	76,400	1,559.00	119,107,600
IHI	70,900	1,573.00	111,525,700
名村造船所	31,800	154.00	4,897,200

サノヤホールディングス	12,300	155.00	1,906,500	
スプリックス	2,800	691.00	1,934,800	
マネジメントソリューションズ	2,900	1,257.00	3,645,300	
プロレド・パートナーズ	1,200	5,110.00	6,132,000	
カーブスホールディングス	23,700	556.00	13,177,200	
フォーラムエンジニアリング	4,900	758.00	3,714,200	
日本車輛製造	3,600	2,542.00	9,151,200	
三菱ロジスネクスト	13,100	912.00	11,947,200	
近畿車輛	1,600	1,180.00	1,888,000	
F P G	30,200	547.00	16,519,400	
島根銀行	2,000	535.00	1,070,000	
じもとホールディングス	66,800	94.00	6,279,200	
全国保証	27,300	3,905.00	106,606,500	
めぶきフィナンシャルグループ	504,100	253.00	127,537,300	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,200	1,149.00	15,166,800	
九州フィナンシャルグループ	212,300	449.00	95,322,700	
かんぼ生命保険	34,200	1,447.00	49,487,400	
ゆうちょ銀行	274,600	827.00	227,094,200	
富山第一銀行	23,000	269.00	6,187,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	554,100	347.00	192,272,700	
ジェイリース	2,900	332.00	962,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	64,500	709.00	45,730,500	
マーキュリアインベストメント	4,400	567.00	2,494,800	
イントラスト	3,500	726.00	2,541,000	
日本モーゲージサービス	2,000	2,044.00	4,088,000	
C A S A	3,500	1,075.00	3,762,500	
アルヒ	15,500	1,635.00	25,342,500	
プレミアグループ	5,300	1,863.00	9,873,900	
日産自動車	1,160,000	391.70	454,372,000	
いすゞ自動車	285,200	964.20	274,989,840	
トヨタ自動車	1,097,900	6,762.00	7,423,999,800	代用有価証券 250,000株
日野自動車	123,000	720.00	88,560,000	
三菱自動車工業	363,600	274.00	99,626,400	
エフテック	7,100	489.00	3,471,900	
レシップホールディングス	4,200	540.00	2,268,000	
G M B	1,800	573.00	1,031,400	
ファルテック	1,800	646.00	1,162,800	
武蔵精密工業	22,000	889.00	19,558,000	
日産車体	19,200	906.00	17,395,200	
新明和工業	26,500	1,009.00	26,738,500	
極東開発工業	18,300	1,351.00	24,723,300	
日信工業	20,100	2,217.00	44,561,700	
トピー工業	8,100	1,170.00	9,477,000	
ティラド	3,700	1,300.00	4,810,000	
曙ブレーキ工業	54,400	172.00	9,356,800	
タチエス	16,200	892.00	14,450,400	
N O K	52,900	1,324.00	70,039,600	

フタバ産業	27,400	431.00	11,809,400
K Y B	11,000	1,944.00	21,384,000
市光工業	14,900	485.00	7,226,500
大同メタル工業	18,900	535.00	10,111,500
プレス工業	48,800	297.00	14,493,600
ミクニ	12,800	263.00	3,366,400
太平洋工業	20,600	901.00	18,560,600
ケーヒン	22,700	2,553.00	57,953,100
河西工業	13,200	428.00	5,649,600
アイシン精機	81,100	3,120.00	253,032,000
マツダ	289,300	683.00	197,591,900
今仙電機製作所	9,500	687.00	6,526,500
本田技研工業	774,600	2,793.00	2,163,457,800
スズキ	195,100	3,853.00	751,720,300
S U B A R U	305,400	2,249.00	686,844,600
安永	4,700	1,011.00	4,751,700
ヤマハ発動機	128,200	1,698.00	217,683,600
ショーワ	23,200	2,257.00	52,362,400
小糸製作所	59,000	4,435.00	261,665,000
T B K	11,900	434.00	5,164,600
エクセディ	13,400	1,488.00	19,939,200
ミツバ	18,200	386.00	7,025,200
豊田合成	31,700	2,186.00	69,296,200
愛三工業	15,400	514.00	7,915,600
盟和産業	1,600	872.00	1,395,200
日本プラスト	7,600	443.00	3,366,800
ヨロズ	9,200	1,040.00	9,568,000
エフ・シー・シー	16,100	1,799.00	28,963,900
新家工業	2,200	1,155.00	2,541,000
シマノ	36,800	21,090.00	776,112,000
テイ・エス テック	22,700	2,900.00	65,830,000
関西みらいフィナンシャルグループ	56,800	401.00	22,776,800
三十三フィナンシャルグループ	9,000	1,335.00	12,015,000
第四北越フィナンシャルグループ	16,700	2,053.00	34,285,100
ジャムコ	4,900	728.00	3,567,200
小野建	8,600	1,207.00	10,380,200
はるやまホールディングス	4,400	702.00	3,088,800
南陽	2,100	1,527.00	3,206,700
ノジマ	17,200	2,709.00	46,594,800
佐島電機	6,700	798.00	5,346,600
カッパ・クリエイト	13,600	1,373.00	18,672,800
エコートレーディング	2,400	517.00	1,240,800
伯東	5,900	963.00	5,681,700
コンドーテック	7,500	1,135.00	8,512,500
中山福	5,400	425.00	2,295,000
ライトオン	7,300	588.00	4,292,400
ナガイレーベン	12,900	2,777.00	35,823,300
ジーンズメイト	3,100	222.00	688,200
三菱食品	10,500	2,820.00	29,610,000
良品計画	128,800	1,350.00	173,880,000

三城ホールディングス	10,400	258.00	2,683,200
松田産業	7,100	1,385.00	9,833,500
第一興商	14,400	3,155.00	45,432,000
メディバルホールディングス	104,500	2,031.00	212,239,500
アドヴァン	14,700	1,310.00	19,257,000
S P K	4,300	1,263.00	5,430,900
萩原電気ホールディングス	3,700	1,971.00	7,292,700
アルビス	3,700	2,338.00	8,650,600
アズワン	6,300	11,350.00	71,505,000
スズデン	3,400	1,192.00	4,052,800
尾家産業	2,900	1,292.00	3,746,800
シモジマ	5,900	1,175.00	6,932,500
ドウシシャ	9,300	1,672.00	15,549,600
小津産業	2,300	1,717.00	3,949,100
コナカ	11,400	300.00	3,420,000
高速	5,700	1,395.00	7,951,500
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,589.00	2,065,700
G - 7ホールディングス	5,700	2,476.00	14,113,200
たけびし	3,400	1,347.00	4,579,800
イオン北海道	11,900	779.00	9,270,100
コジマ	16,700	555.00	9,268,500
ヒマラヤ	3,500	813.00	2,845,500
コーナン商事	13,800	3,620.00	49,956,000
ネットワンシステムズ	36,800	3,570.00	131,376,000
エコス	3,500	2,132.00	7,462,000
ワタミ	11,600	904.00	10,486,400
マルシェ	2,700	482.00	1,301,400
リックス	2,200	1,637.00	3,601,400
システムソフト	24,700	95.00	2,346,500
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	213,100	2,405.00	512,505,500
丸文	8,300	539.00	4,473,700
西松屋チェーン	21,300	1,113.00	23,706,900
ゼンショーホールディングス	46,500	2,082.00	96,813,000
ハピネット	8,000	1,116.00	8,928,000
幸楽苑ホールディングス	6,200	1,521.00	9,430,200
ハークスレイ	2,000	1,025.00	2,050,000
橋本総業ホールディングス	2,000	2,054.00	4,108,000
日本ライフライン	28,800	1,331.00	38,332,800
サイゼリヤ	14,400	1,912.00	27,532,800
タカショー	4,800	487.00	2,337,600
V Tホールディングス	40,500	355.00	14,377,500
マルカ	3,500	1,786.00	6,251,000
アルゴグラフィックス	8,200	3,325.00	27,265,000
魚力	2,700	1,597.00	4,311,900
I D O M	26,400	515.00	13,596,000
日本エム・ディ・エム	5,600	1,557.00	8,719,200
ポブラ	2,700	390.00	1,053,000
フジ・コーポレーション	2,600	1,957.00	5,088,200
ユナイテッドアローズ	10,200	1,657.00	16,901,400

進和	5,700	1,939.00	11,052,300
エスケイジャパン	2,100	264.00	554,400
ダイترون	4,200	1,478.00	6,207,600
ハイデイ日高	14,000	1,601.00	22,414,000
シークス	12,500	940.00	11,750,000
京都きもの友禅	6,500	259.00	1,683,500
コロワイド	32,200	1,365.00	43,953,000
ピーシーデポコーポレーション	13,100	707.00	9,261,700
田中商事	3,100	698.00	2,163,800
オーハシテクニカ	5,400	1,599.00	8,634,600
壱番屋	6,800	4,920.00	33,456,000
白銅	3,500	1,415.00	4,952,500
トップカルチャー	3,700	343.00	1,269,100
P L A N T	2,700	687.00	1,854,900
スギホールディングス	19,400	7,630.00	148,022,000
薬王堂ホールディングス	4,300	2,758.00	11,859,400
島津製作所	117,700	2,918.00	343,448,600
J M S	8,400	775.00	6,510,000
クボテック	2,700	361.00	974,700
長野計器	7,200	1,030.00	7,416,000
ブイ・テクノロジー	4,600	3,560.00	16,376,000
スター精密	15,200	1,307.00	19,866,400
東京計器	6,500	955.00	6,207,500
愛知時計電機	1,300	4,520.00	5,876,000
インターアクション	5,300	1,976.00	10,472,800
オーバル	8,700	216.00	1,879,200
東京精密	17,900	3,460.00	61,934,000
マニー	39,300	2,893.00	113,694,900
ニコン	150,100	891.00	133,739,100
トプコン	49,600	837.00	41,515,200
オリンパス	544,500	2,038.00	1,109,691,000
理研計器	8,700	2,410.00	20,967,000
S C R E E Nホールディングス	17,100	5,400.00	92,340,000
キヤノン電子	10,400	1,621.00	16,858,400
タムロン	7,900	1,814.00	14,330,600
H O Y A	195,200	10,860.00	2,119,872,000
シード	4,300	704.00	3,027,200
ノーリツ鋼機	6,700	1,599.00	10,713,300
エー・アンド・デイ	9,100	683.00	6,215,300
朝日インテック	111,500	2,971.00	331,266,500
キヤノン	529,600	2,110.50	1,117,720,800
リコー	250,300	801.00	200,490,300
シチズン時計	115,600	332.00	38,379,200
リズム時計工業	3,100	607.00	1,881,700
大研医器	7,000	570.00	3,990,000
メニコン	14,000	5,280.00	73,920,000
シンシア	1,300	372.00	483,600
中本パックス	2,600	1,512.00	3,931,200
スノーピーク	5,100	1,268.00	6,466,800
パラマウントベッドホールディングス	10,400	4,500.00	46,800,000

トランザクション	5,400	1,077.00	5,815,800	
粧美堂	3,000	344.00	1,032,000	
ニホンフラッシュ	9,200	1,410.00	12,972,000	
前田工織	10,900	2,493.00	27,173,700	
永大産業	13,000	287.00	3,731,000	
アートネイチャー	10,600	621.00	6,582,600	
パンダイナムコホールディングス	101,700	5,908.00	600,843,600	
アイフィスジャパン	2,700	723.00	1,952,100	
共立印刷	16,300	136.00	2,216,800	
SHOEI	8,700	2,694.00	23,437,800	
フランスベッドホールディングス	14,000	843.00	11,802,000	
マーベラス	14,800	708.00	10,478,400	
パイロットコーポレーション	16,000	3,355.00	53,680,000	
萩原工業	5,400	1,445.00	7,803,000	
エイベックス	16,500	884.00	14,586,000	
トッパン・フォームズ	21,200	1,074.00	22,768,800	
フジシールインターナショナル	22,000	1,985.00	43,670,000	
タカラトミー	44,200	857.00	37,879,400	
廣済堂	7,100	793.00	5,630,300	
エステールホールディングス	2,600	626.00	1,627,600	
アーク	36,300	114.00	4,138,200	
レック	10,600	1,454.00	15,412,400	
タカノ	4,000	687.00	2,748,000	
三光合成	11,500	257.00	2,955,500	
プロネクサス	8,400	1,182.00	9,928,800	
ホクシン	6,500	118.00	767,000	
ウッドワン	3,300	1,109.00	3,659,700	
大建工業	6,600	1,795.00	11,847,000	
きもと	17,500	179.00	3,132,500	
凸版印刷	138,900	1,743.00	242,102,700	
大日本印刷	128,800	2,477.00	319,037,600	
共同印刷	3,000	2,735.00	8,205,000	
NISSHA	20,400	984.00	20,073,600	
光村印刷	900	1,501.00	1,350,900	
藤森工業	8,800	3,605.00	31,724,000	
ヴィア・ホールディングス	11,900	346.00	4,117,400	
TAKARA & COMPANY	4,700	2,137.00	10,043,900	
前澤化成工業	6,200	995.00	6,169,000	
未来工業	5,300	1,891.00	10,022,300	
アシックス	81,400	1,268.00	103,215,200	
ツツミ	3,100	1,850.00	5,735,000	
ウェーブロックホールディングス	3,500	869.00	3,041,500	
JSP	5,700	1,456.00	8,299,200	
ニチハ	13,700	2,287.00	31,331,900	
エフピコ	10,900	8,680.00	94,612,000	
小松ウオール工業	3,100	1,808.00	5,604,800	
ヤマハ	58,500	4,865.00	284,602,500	
河合楽器製作所	3,100	2,657.00	8,236,700	
クリナップ	9,200	563.00	5,179,600	
ビジョン	59,500	4,435.00	263,882,500	

天馬	6,500	1,641.00	10,666,500
オリバー	2,100	2,421.00	5,084,100
兼松サステック	600	1,469.00	881,400
キングジム	8,300	835.00	6,930,500
象印マホービン	28,900	1,380.00	39,882,000
リンテック	23,300	2,594.00	60,440,200
信越ポリマー	17,800	919.00	16,358,200
東リ	24,300	253.00	6,147,900
イトーキ	21,000	337.00	7,077,000
任天堂	60,300	48,800.00	2,942,640,000
三菱鉛筆	16,100	1,277.00	20,559,700
松風	4,400	1,399.00	6,155,600
タカラスタンダード	20,300	1,537.00	31,201,100
コクヨ	47,100	1,264.00	59,534,400
ナカバヤシ	9,800	567.00	5,556,600
ニフコ	36,100	2,277.00	82,199,700
立川ブラインド工業	4,300	1,154.00	4,962,200
グロープライド	4,400	2,091.00	9,200,400
オカムラ	34,200	760.00	25,992,000
パルカー	8,000	1,863.00	14,904,000
MUTOHホールディングス	1,300	1,501.00	1,951,300
伊藤忠商事	677,900	2,367.50	1,604,928,250
丸紅	1,008,500	489.90	494,064,150
スクロール	14,900	466.00	6,943,400
高島	1,600	1,743.00	2,788,800
ヨンドシーホールディングス	9,800	1,902.00	18,639,600
三陽商会	4,900	633.00	3,101,700
長瀬産業	54,400	1,314.00	71,481,600
ナイガイ	3,700	357.00	1,320,900
蝶理	6,100	1,679.00	10,241,900
豊田通商	108,100	2,763.00	298,680,300
オンワードホールディングス	57,900	303.00	17,543,700
三共生興	14,300	440.00	6,292,000
兼松	36,100	1,284.00	46,352,400
美津濃	8,900	2,020.00	17,978,000
ツカモトコーポレーション	1,800	1,126.00	2,026,800
ファミリーマート	77,400	2,318.00	179,413,200
ルックホールディングス	3,300	726.00	2,395,800
三井物産	839,200	1,602.50	1,344,818,000
日本紙パルプ商事	5,400	3,790.00	20,466,000
東京エレクトロン	62,400	29,270.00	1,826,448,000
カメイ	12,500	1,032.00	12,900,000
東都水産	1,200	3,290.00	3,948,000
OUGホールディングス	1,600	2,647.00	4,235,200
スターゼン	3,500	4,210.00	14,735,000
セイコーホールディングス	13,900	1,669.00	23,199,100
山善	37,900	937.00	35,512,300
椿本興業	1,800	3,225.00	5,805,000
住友商事	611,200	1,252.00	765,222,400
日本ユニシス	30,200	3,280.00	99,056,000

内田洋行	3,900	6,330.00	24,687,000
三菱商事	635,500	2,278.00	1,447,669,000
第一実業	4,700	3,850.00	18,095,000
キヤノンマーケティングジャパン	24,000	2,179.00	52,296,000
西華産業	5,400	1,225.00	6,615,000
佐藤商事	7,900	887.00	7,007,300
菱洋エレクトロ	9,800	3,180.00	31,164,000
東京産業	9,000	512.00	4,608,000
ユアサ商事	9,200	3,015.00	27,738,000
神鋼商事	2,500	1,855.00	4,637,500
トルク	5,900	280.00	1,652,000
阪和興業	18,200	2,000.00	36,400,000
正栄食品工業	6,200	3,925.00	24,335,000
カナデン	7,900	1,305.00	10,309,500
菱電商事	7,100	1,455.00	10,330,500
ニプロ	68,100	1,149.00	78,246,900
フルサト工業	5,400	1,343.00	7,252,200
岩谷産業	21,600	3,745.00	80,892,000
ナイス	4,300	872.00	3,749,600
昭光通商	3,300	588.00	1,940,400
ニチモウ	1,600	1,872.00	2,995,200
極東貿易	2,900	1,266.00	3,671,400
イワキ	13,100	480.00	6,288,000
兼松エレクトロニクス	5,300	4,035.00	21,385,500
三愛石油	23,900	919.00	21,964,100
稲畑産業	21,300	1,284.00	27,349,200
G S Iクレオス	2,500	1,184.00	2,960,000
明和産業	9,200	453.00	4,167,600
クワザワ	3,500	531.00	1,858,500
キムラタン	53,300	25.00	1,332,500
ヤマエ久野	7,100	1,290.00	9,159,000
ゴールドウイン	17,500	6,620.00	115,850,000
ユニ・チャーム	189,700	4,891.00	927,822,700
デサント	18,800	1,664.00	31,283,200
キング	4,600	515.00	2,369,000
ワキタ	20,600	948.00	19,528,800
ヤマトインターナショナル	5,900	359.00	2,118,100
東邦ホールディングス	31,000	1,943.00	60,233,000
サンゲツ	26,300	1,487.00	39,108,100
ミツウロコグループホールディングス	14,200	1,147.00	16,287,400
シナネンホールディングス	4,000	2,775.00	11,100,000
伊藤忠エネクス	21,300	858.00	18,275,400
サンリオ	27,100	1,573.00	42,628,300
サンワテクノス	7,000	860.00	6,020,000
リョーサン	10,700	2,175.00	23,272,500
新光商事	15,400	849.00	13,074,600
トーヨー	4,400	1,861.00	8,188,400
三信電気	5,300	1,723.00	9,131,900
東陽テクニカ	10,600	969.00	10,271,400
モスフードサービス	12,800	2,753.00	35,238,400

加賀電子	9,800	2,034.00	19,933,200
三益半導体工業	7,600	2,364.00	17,966,400
ソーダニッカ	10,000	514.00	5,140,000
立花エレテック	7,200	1,742.00	12,542,400
木曽路	12,700	2,320.00	29,464,000
S R S ホールディングス	11,600	863.00	10,010,800
千趣会	17,800	351.00	6,247,800
タカキュー	8,000	130.00	1,040,000
リテールパートナーズ	12,900	2,103.00	27,128,700
ケーヨー	19,900	797.00	15,860,300
上新電機	11,400	2,135.00	24,339,000
日本瓦斯	15,300	4,805.00	73,516,500
ロイヤルホールディングス	17,000	1,708.00	29,036,000
東天紅	700	967.00	676,900
いなげや	12,000	1,743.00	20,916,000
島忠	18,300	3,010.00	55,083,000
チヨダ	10,000	1,004.00	10,040,000
ライフコーポレーション	7,400	4,175.00	30,895,000
リンガーハット	12,000	2,156.00	25,872,000
MrMaxHD	13,200	654.00	8,632,800
テンアライド	9,000	364.00	3,276,000
AOKIホールディングス	19,300	594.00	11,464,200
オークワ	15,200	1,555.00	23,636,000
コメリ	14,900	2,828.00	42,137,200
青山商事	20,100	636.00	12,783,600
しまむら	11,300	7,430.00	83,959,000
はせがわ	5,300	301.00	1,595,300
高島屋	70,500	808.00	56,964,000
松屋	19,600	642.00	12,583,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	45,600	674.00	30,734,400
近鉄百貨店	3,700	2,782.00	10,293,400
丸井グループ	88,800	1,752.00	155,577,600
クレディセゾン	68,000	1,119.00	76,092,000
アクシアル リテイリング	8,000	4,570.00	36,560,000
井筒屋	5,600	179.00	1,002,400
イオン	372,900	2,454.00	915,096,600
イズミ	19,700	3,355.00	66,093,500
フォーバル	4,300	976.00	4,196,800
平和堂	19,600	1,915.00	37,534,000
フジ	11,700	1,818.00	21,270,600
ヤオコー	11,100	8,150.00	90,465,000
ゼビオホールディングス	11,800	792.00	9,345,600
ケーズホールディングス	93,500	1,401.00	130,993,500
PALTAC	15,500	5,160.00	79,980,000
三谷産業	12,900	335.00	4,321,500
Olympicグループ	5,100	933.00	4,758,300
日産東京販売ホールディングス	14,600	252.00	3,679,200
新生銀行	71,300	1,308.00	93,260,400
あおぞら銀行	57,800	1,883.00	108,837,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,639,200	422.10	2,802,406,320

りそなホールディングス	1,064,900	370.50	394,545,450	
三井住友トラスト・ホールディングス	183,300	2,996.50	549,258,450	
三井住友フィナンシャルグループ	671,200	3,071.00	2,061,255,200	
千葉銀行	323,700	518.00	167,676,600	
群馬銀行	186,300	337.00	62,783,100	
武蔵野銀行	14,300	1,558.00	22,279,400	
千葉興業銀行	27,100	223.00	6,043,300	
筑波銀行	41,200	163.00	6,715,600	
七十七銀行	32,700	1,549.00	50,652,300	
青森銀行	7,500	2,192.00	16,440,000	
秋田銀行	6,200	1,474.00	9,138,800	
山形銀行	11,000	1,274.00	14,014,000	
岩手銀行	6,300	2,530.00	15,939,000	
東邦銀行	86,800	224.00	19,443,200	
東北銀行	4,700	939.00	4,413,300	
みちのく銀行	6,400	1,007.00	6,444,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	81,700	1,694.00	138,399,800	
静岡銀行	236,400	699.00	165,243,600	
十六銀行	12,100	1,948.00	23,570,800	
スルガ銀行	99,500	372.00	37,014,000	
八十二銀行	234,000	408.00	95,472,000	
山梨中央銀行	11,400	853.00	9,724,200	
大垣共立銀行	19,200	2,207.00	42,374,400	
福井銀行	8,300	1,612.00	13,379,600	
北國銀行	9,700	2,947.00	28,585,900	
清水銀行	4,100	1,579.00	6,473,900	
富山銀行	1,900	2,220.00	4,218,000	
滋賀銀行	19,500	2,474.00	48,243,000	
南都銀行	16,200	2,048.00	33,177,600	
百五銀行	87,200	324.00	28,252,800	
京都銀行	34,700	3,910.00	135,677,000	
紀陽銀行	34,300	1,632.00	55,977,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	64,200	893.00	57,330,600	
広島銀行	143,000	508.00	72,644,000	
山陰合同銀行	57,400	528.00	30,307,200	
中国銀行	83,600	982.00	82,095,200	
鳥取銀行	3,500	1,103.00	3,860,500	
伊予銀行	138,500	663.00	91,825,500	
百十四銀行	10,300	1,802.00	18,560,600	
四国銀行	14,700	768.00	11,289,600	
阿波銀行	15,800	2,366.00	37,382,800	
大分銀行	5,500	2,362.00	12,991,000	
宮崎銀行	6,500	2,332.00	15,158,000	
佐賀銀行	5,800	1,197.00	6,942,600	
沖縄銀行	8,900	3,085.00	27,456,500	
琉球銀行	22,400	936.00	20,966,400	
セブン銀行	324,500	288.00	93,456,000	
みずほフィナンシャルグループ	13,186,500	134.20	1,769,628,300	
高知銀行	3,500	630.00	2,205,000	
山口フィナンシャルグループ	120,800	650.00	78,520,000	

芙蓉総合リース	10,100	5,890.00	59,489,000
みずほリース	14,900	2,368.00	35,283,200
東京センチュリー	19,600	5,490.00	107,604,000
SBIホールディングス	108,500	2,186.00	237,181,000
日本証券金融	42,700	493.00	21,051,100
アイフル	148,600	224.00	33,286,400
日本アジア投資	8,600	228.00	1,960,800
長野銀行	3,300	1,042.00	3,438,600
名古屋銀行	7,300	2,378.00	17,359,400
北洋銀行	145,700	211.00	30,742,700
愛知銀行	3,500	2,765.00	9,677,500
中京銀行	4,100	2,054.00	8,421,400
大光銀行	3,400	1,379.00	4,688,600
愛媛銀行	13,700	1,183.00	16,207,100
トマト銀行	3,900	983.00	3,833,700
京葉銀行	41,200	514.00	21,176,800
栃木銀行	47,300	160.00	7,568,000
北日本銀行	3,100	1,748.00	5,418,800
東和銀行	17,100	676.00	11,559,600
福島銀行	9,800	160.00	1,568,000
大東銀行	5,200	615.00	3,198,000
リコーリース	7,600	2,963.00	22,518,800
イオンフィナンシャルサービス	59,400	903.00	53,638,200
アコム	195,100	382.00	74,528,200
ジャックス	10,700	1,666.00	17,826,200
オリエントコーポレーション	261,400	110.00	28,754,000
日立キャピタル	22,900	2,385.00	54,616,500
アプラスフィナンシャル	46,900	65.00	3,048,500
オリックス	602,200	1,289.00	776,235,800
三菱UFJリース	245,700	489.00	120,147,300
ジャフコ	14,900	3,720.00	55,428,000
九州リースサービス	4,500	541.00	2,434,500
トモニホールディングス	75,000	344.00	25,800,000
大和証券グループ本社	778,900	469.10	365,381,990
野村ホールディングス	1,707,800	492.90	841,774,620
岡三証券グループ	82,900	330.00	27,357,000
丸三証券	29,300	407.00	11,925,100
東洋証券	34,900	114.00	3,978,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	111,500	232.00	25,868,000
光世証券	2,300	536.00	1,232,800
水戸証券	28,500	194.00	5,529,000
いちよし証券	18,400	435.00	8,004,000
松井証券	55,600	847.00	47,093,200
SOMPOホールディングス	182,500	3,740.00	682,550,000
日本取引所グループ	278,700	2,593.00	722,669,100
マネックスグループ	71,800	220.00	15,796,000
極東証券	13,200	510.00	6,732,000
岩井コスモホールディングス	9,400	1,117.00	10,499,800
藍澤証券	17,600	704.00	12,390,400

フィデアホールディングス	95,800	100.00	9,580,000
池田泉州ホールディングス	111,900	160.00	17,904,000
アニコムホールディングス	8,000	4,575.00	36,600,000
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	253,700	2,891.00	733,446,700
ソニーフィナンシャルホールディング ス	79,700	2,598.00	207,060,600
マネーパートナーズグループ	10,700	208.00	2,225,600
スパークス・グループ	34,000	210.00	7,140,000
小林洋行	2,900	248.00	719,200
第一生命ホールディングス	549,200	1,320.50	725,218,600
東京海上ホールディングス	343,200	4,745.00	1,628,484,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,800	814.00	3,907,200
イー・ギャランティ	10,400	2,593.00	26,967,200
アサックス	5,100	657.00	3,350,700
NECキャピタルソリューション	3,900	1,935.00	7,546,500
T & Dホールディングス	289,900	942.00	273,085,800
アドバンスクリエイト	2,100	2,058.00	4,321,800
三井不動産	478,700	1,791.00	857,351,700
三菱地所	680,100	1,546.50	1,051,774,650
平和不動産	17,900	2,947.00	52,751,300
東京建物	102,200	1,167.00	119,267,400
ダイビル	25,000	1,034.00	25,850,000
京阪神ビルディング	15,800	1,328.00	20,982,400
住友不動産	218,100	2,700.50	588,979,050
太平洋興発	4,000	622.00	2,488,000
テーオーシー	19,200	686.00	13,171,200
東京楽天地	1,600	4,070.00	6,512,000
レオパレス21	127,500	182.00	23,205,000
スターツコーポレーション	13,200	2,188.00	28,881,600
フジ住宅	11,300	536.00	6,056,800
空港施設	9,600	423.00	4,060,800
明和地所	4,900	393.00	1,925,700
ゴールドクレスト	7,600	1,403.00	10,662,800
リログループ	51,400	2,037.00	104,701,800
エスリード	3,800	1,331.00	5,057,800
日神グループホールディングス	14,500	357.00	5,176,500
日本エスコン	17,800	791.00	14,079,800
タカラレーベン	44,800	356.00	15,948,800
A V A N T I A	5,400	889.00	4,800,600
イオンモール	48,600	1,321.00	64,200,600
毎日コムネット	2,500	779.00	1,947,500
ファースト住建	4,200	960.00	4,032,000
ランド	538,700	10.00	5,387,000
カチタス	24,100	2,514.00	60,587,400
東祥	5,900	1,250.00	7,375,000
トーセイ	13,400	893.00	11,966,200
穴吹興産	2,200	1,464.00	3,220,800
サンフロンティア不動産	13,500	831.00	11,218,500
エフ・ジェー・ネクスト	8,500	861.00	7,318,500

インテリックス	2,800	503.00	1,408,400
ランドビジネス	3,600	336.00	1,209,600
サンネクスタグループ	2,400	1,023.00	2,455,200
グランディハウス	7,600	366.00	2,781,600
東武鉄道	102,500	3,435.00	352,087,500
相鉄ホールディングス	31,400	2,788.00	87,543,200
東急	248,100	1,402.00	347,836,200
京浜急行電鉄	126,400	1,585.00	200,344,000
小田急電鉄	146,300	2,640.00	386,232,000
京王電鉄	51,000	5,940.00	302,940,000
京成電鉄	68,400	3,165.00	216,486,000
富士急行	13,400	3,250.00	43,550,000
新京成電鉄	2,600	2,177.00	5,660,200
東日本旅客鉄道	173,100	7,229.00	1,251,339,900
西日本旅客鉄道	87,700	5,424.00	475,684,800
東海旅客鉄道	81,800	15,430.00	1,262,174,000
西武ホールディングス	128,500	1,145.00	147,132,500
鴻池運輸	15,500	1,086.00	16,833,000
西日本鉄道	27,200	2,873.00	78,145,600
ハマキョウレックス	7,600	3,235.00	24,586,000
サカイ引越センター	5,200	5,280.00	27,456,000
近鉄グループホールディングス	93,100	4,660.00	433,846,000
阪急阪神ホールディングス	124,300	3,490.00	433,807,000
南海電気鉄道	44,200	2,413.00	106,654,600
京阪ホールディングス	41,500	4,660.00	193,390,000
神戸電鉄	2,300	3,595.00	8,268,500
名古屋鉄道	76,600	2,946.00	225,663,600
山陽電気鉄道	6,600	2,158.00	14,242,800
トランコム	2,700	7,170.00	19,359,000
日本通運	32,200	5,710.00	183,862,000
ヤマトホールディングス	163,400	2,744.00	448,369,600
山九	25,800	4,025.00	103,845,000
日新	8,000	1,504.00	12,032,000
丸運	5,400	220.00	1,188,000
丸全昭和運輸	7,600	3,090.00	23,484,000
センコーグループホールディングス	51,300	814.00	41,758,200
トナミホールディングス	2,300	5,700.00	13,110,000
ニッコンホールディングス	33,200	2,088.00	69,321,600
日本石油輸送	1,000	3,165.00	3,165,000
福山通運	12,000	3,780.00	45,360,000
セイノーホールディングス	69,700	1,397.00	97,370,900
エスライン	2,900	946.00	2,743,400
神奈川中央交通	2,400	4,020.00	9,648,000
日立物流	17,100	2,930.00	50,103,000
丸和運輸機関	9,800	3,335.00	32,683,000
C & F ロジホールディングス	9,500	1,556.00	14,782,000
日本郵船	77,800	1,505.00	117,089,000
商船三井	58,800	1,975.00	116,130,000
川崎汽船	28,800	1,058.00	30,470,400
N S ユナイテッド海運	5,000	1,480.00	7,400,000

明治海運	10,200	322.00	3,284,400
飯野海運	44,000	340.00	14,960,000
共栄タンカー	1,700	792.00	1,346,400
九州旅客鉄道	81,700	2,567.00	209,723,900
S Gホールディングス	97,900	3,755.00	367,614,500
日本航空	164,800	1,985.00	327,128,000
A N Aホールディングス	170,400	2,461.50	419,439,600
パスコ	1,900	1,450.00	2,755,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	1,800	2,155.00	3,879,000
シルバーライフ	1,300	1,987.00	2,583,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,800.00	1,620,000
Genky DrugStores	4,300	3,635.00	15,630,500
国際紙パルプ商事	23,200	288.00	6,681,600
ナルミヤ・インターナショナル	1,700	570.00	969,000
ブックオフグループホールディングス	5,700	790.00	4,503,000
三菱倉庫	29,500	2,756.00	81,302,000
三井倉庫ホールディングス	10,600	1,535.00	16,271,000
住友倉庫	33,300	1,268.00	42,224,400
澁澤倉庫	5,100	1,993.00	10,164,300
ヤマタネ	4,800	1,184.00	5,683,200
東陽倉庫	16,900	309.00	5,222,100
乾汽船	5,400	827.00	4,465,800
日本トランスシティ	20,500	478.00	9,799,000
ケイヒン	1,800	1,245.00	2,241,000
中央倉庫	5,600	956.00	5,353,600
川西倉庫	1,800	998.00	1,796,400
安田倉庫	7,600	883.00	6,710,800
ファイズホールディングス	2,000	1,060.00	2,120,000
東洋埠頭	2,900	1,371.00	3,975,900
宇徳	7,900	483.00	3,815,700
上組	52,000	2,076.00	107,952,000
サンリツ	2,300	579.00	1,331,700
キムラユニティー	2,500	1,000.00	2,500,000
キューソー流通システム	2,400	1,462.00	3,508,800
近鉄エクスプレス	19,800	1,895.00	37,521,000
東海運	5,400	269.00	1,452,600
エーアイティー	6,800	871.00	5,922,800
内外トランスライン	3,400	1,020.00	3,468,000
ショーエイコーポレーション	1,300	887.00	1,153,100
日本コンセプト	3,100	1,246.00	3,862,600
東京放送ホールディングス	58,700	1,671.00	98,087,700
日本テレビホールディングス	80,500	1,180.00	94,990,000
朝日放送グループホールディングス	9,500	740.00	7,030,000
テレビ朝日ホールディングス	26,600	1,528.00	40,644,800
スカパーJ S A Tホールディングス	63,400	423.00	26,818,200
テレビ東京ホールディングス	7,800	2,349.00	18,322,200
日本BS放送	3,300	1,082.00	3,570,600
ビジョン	9,200	652.00	5,998,400
スマートパリュウ	2,600	1,191.00	3,096,600

USEN - NEXT HOLDING S	3,800	1,400.00	5,320,000	
ワイヤレスゲート	4,700	773.00	3,633,100	
コネクシオ	5,400	1,404.00	7,581,600	
日本通信	75,800	207.00	15,690,600	
クロップス	2,000	723.00	1,446,000	
日本電信電話	1,290,800	2,543.50	3,283,149,800	
KDDI	704,000	3,310.00	2,330,240,000	
ソフトバンク	877,500	1,403.00	1,231,132,500	
光通信	9,900	22,670.00	224,433,000	
NTTドコモ	690,500	2,950.50	2,037,320,250	
エムティーアイ	9,600	808.00	7,756,800	
GMOインターネット	38,100	3,040.00	115,824,000	
ファイバーゲート	2,300	1,547.00	3,558,100	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,000	460.00	1,380,000	
KADOKAWA	26,000	2,325.00	60,450,000	
学研ホールディングス	13,000	1,442.00	18,746,000	
ゼンリン	19,400	1,185.00	22,989,000	
昭文社ホールディングス	4,400	436.00	1,918,400	
インプレスホールディングス	8,200	146.00	1,197,200	
東京電力ホールディングス	785,000	318.00	249,630,000	
中部電力	301,000	1,368.50	411,918,500	
関西電力	372,700	1,083.00	403,634,100	
中国電力	142,000	1,407.00	199,794,000	
北陸電力	90,000	682.00	61,380,000	
東北電力	245,500	1,031.00	253,110,500	
四国電力	88,300	799.00	70,551,700	
九州電力	202,800	909.00	184,345,200	
北海道電力	92,100	408.00	37,576,800	
沖縄電力	19,100	1,778.00	33,959,800	
電源開発	78,200	1,822.00	142,480,400	
エフオン	5,600	604.00	3,382,400	
イーレックス	14,100	1,426.00	20,106,600	
レノバ	16,500	1,033.00	17,044,500	
東京瓦斯	189,400	2,635.00	499,069,000	
大阪瓦斯	191,000	2,169.00	414,279,000	
東邦瓦斯	48,500	5,490.00	266,265,000	
北海道瓦斯	5,300	1,580.00	8,374,000	
広島ガス	20,300	357.00	7,247,100	
西部瓦斯	11,100	2,581.00	28,649,100	
静岡ガス	28,000	889.00	24,892,000	
メタウォーター	4,700	4,775.00	22,442,500	
アイネット	4,900	1,527.00	7,482,300	
松竹	6,400	14,390.00	92,096,000	
東宝	57,000	3,630.00	206,910,000	
エイチ・アイ・エス	14,700	1,609.00	23,652,300	
東映	3,600	14,460.00	52,056,000	
ラックランド	2,300	2,113.00	4,859,900	
エヌ・ティ・ティ・データ	257,300	1,224.00	314,935,200	

共立メンテナンス	15,600	3,610.00	56,316,000
イチネンホールディングス	10,600	1,127.00	11,946,200
建設技術研究所	6,600	1,751.00	11,556,600
スペース	6,100	927.00	5,654,700
長 大	3,500	1,076.00	3,766,000
アインホールディングス	12,000	7,000.00	84,000,000
燦ホールディングス	4,200	1,136.00	4,771,200
ピー・シー・エー	1,400	4,075.00	5,705,000
スバル興業	500	8,010.00	4,005,000
東京テアトル	3,900	1,168.00	4,555,200
タナベ経営	1,800	1,288.00	2,318,400
ビジネスブレイン太田昭和	3,400	1,217.00	4,137,800
ナガワ	3,000	7,740.00	23,220,000
よみうりランド	2,000	3,570.00	7,140,000
東京都競馬	6,100	4,025.00	24,552,500
常磐興産	3,800	1,339.00	5,088,200
カナモト	15,400	2,389.00	36,790,600
東京ドーム	38,100	722.00	27,508,200
D T S	21,700	2,257.00	48,976,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41,200	5,550.00	228,660,000
シーイーシー	10,400	1,624.00	16,889,600
カブコン	45,600	4,220.00	192,432,000
西尾レントオール	8,700	2,222.00	19,331,400
アイ・エス・ビー	1,900	2,163.00	4,109,700
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	64,000	32.00	2,048,000
日本空港ビルデング	31,000	4,385.00	135,935,000
トランス・コスモス	9,000	2,587.00	23,283,000
乃村工藝社	40,400	815.00	32,926,000
ジャステック	6,200	1,259.00	7,805,800
S C S K	22,300	5,240.00	116,852,000
藤田観光	4,200	1,545.00	6,489,000
K N T - C Tホールディングス	5,900	970.00	5,723,000
日本管財	10,300	1,921.00	19,786,300
トーカイ	9,100	2,337.00	21,266,700
白洋舎	1,100	2,801.00	3,081,100
セコム	99,900	9,359.00	934,964,100
日本システムウエア	3,300	1,952.00	6,441,600
セントラル警備保障	4,500	3,790.00	17,055,000
アイネス	9,700	1,399.00	13,570,300
丹青社	18,100	709.00	12,832,900
メイテック	11,600	5,120.00	59,392,000
T K C	8,200	6,010.00	49,282,000
富士ソフト	12,400	4,535.00	56,234,000
応用地質	10,200	1,490.00	15,198,000
船井総研ホールディングス	19,500	2,345.00	45,727,500
N S D	31,100	1,946.00	60,520,600
進学会ホールディングス	3,900	455.00	1,774,500
丸紅建材リース	1,000	1,598.00	1,598,000

オオバ	7,000	705.00	4,935,000
コナミホールディングス	35,100	3,405.00	119,515,500
いであ	1,800	1,939.00	3,490,200
学究社	2,900	1,093.00	3,169,700
ベネッセホールディングス	31,300	2,844.00	89,017,200
イオンディライト	11,700	3,125.00	36,562,500
ナック	5,200	872.00	4,534,400
福井コンピュータホールディングス	3,900	2,653.00	10,346,700
ニチイ学館	13,400	1,611.00	21,587,400
ダイセキ	15,900	2,527.00	40,179,300
ステップ	3,500	1,549.00	5,421,500
日鉄物産	6,900	3,435.00	23,701,500
泉州電業	3,000	2,789.00	8,367,000
元気寿司	2,500	2,238.00	5,595,000
トラスコ中山	20,200	2,676.00	54,055,200
ヤマダ電機	295,500	504.00	148,932,000
オートバックスセブン	35,800	1,368.00	48,974,400
モリト	7,000	638.00	4,466,000
アークランドサカモト	15,200	1,862.00	28,302,400
ニトリホールディングス	42,000	22,195.00	932,190,000
グルメ杵屋	7,000	935.00	6,545,000
愛眼	7,900	220.00	1,738,000
ケーユーホールディングス	4,800	818.00	3,926,400
吉野家ホールディングス	31,800	2,069.00	65,794,200
加藤産業	14,000	3,410.00	47,740,000
北恵	1,900	918.00	1,744,200
イノテック	5,100	961.00	4,901,100
イエローハット	18,300	1,505.00	27,541,500
松屋フーズホールディングス	4,600	3,565.00	16,399,000
JBCホールディングス	6,600	1,450.00	9,570,000
JKホールディングス	8,800	791.00	6,960,800
サガミホールディングス	13,100	1,196.00	15,667,600
日伝	8,800	2,257.00	19,861,600
関西スーパーマーケット	8,000	1,138.00	9,104,000
ミロク情報サービス	8,600	2,200.00	18,920,000
北沢産業	7,400	283.00	2,094,200
杉本商事	5,200	1,839.00	9,562,800
因幡電機産業	27,500	2,513.00	69,107,500
王将フードサービス	7,100	5,750.00	40,825,000
プレナス	10,900	1,715.00	18,693,500
ミニストップ	7,200	1,538.00	11,073,600
アークス	19,800	2,628.00	52,034,400
パローホールディングス	21,500	2,202.00	47,343,000
東テック	3,300	2,249.00	7,421,700
ミスミグループ本社	121,500	2,709.00	329,143,500
藤久	900	1,089.00	980,100
アルテック	7,900	250.00	1,975,000
ベルク	4,800	7,800.00	37,440,000
大庄	5,300	1,191.00	6,312,300
タキヒヨー	3,000	1,907.00	5,721,000

ファーストリテイリング	13,000	60,640.00	788,320,000	
ソフトバンクグループ	766,200	6,532.00	5,004,818,400	
蔵王産業	1,900	1,410.00	2,679,000	
スズケン	41,000	3,905.00	160,105,000	
サンドラッグ	36,500	3,530.00	128,845,000	
サックスパー ホールディングス	8,400	554.00	4,653,600	
ジェコス	6,600	875.00	5,775,000	
ヤマザワ	2,300	1,682.00	3,868,600	
やまや	2,000	2,085.00	4,170,000	
グローセル	9,700	412.00	3,996,400	
ペルーナ	20,800	646.00	13,436,800	
合計	116,750,400		217,173,457,940	

(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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,287,424,327
コール・ローン	993,869,091
国債証券	359,389,630,352
派生商品評価勘定	2,036,482,739
未収入金	5,640,561
未収利息	1,897,843,330
前払費用	376,702,176
流動資産合計	367,987,592,576
資産合計	
367,987,592,576	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	344,949,874
未払金	1,979,758,057
未払解約金	10,456,000
流動負債合計	2,335,163,931
負債合計	
2,335,163,931	
純資産の部	
元本等	
元本	247,701,694,163
剰余金	
剰余金又は欠損金()	117,950,734,482
元本等合計	365,652,428,645
純資産合計	
365,652,428,645	
負債純資産合計	
367,987,592,576	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月13日現在
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	341,232,781,383円
同期中追加設定元本額	192,342,632,658円
同期中一部解約元本額	285,873,719,878円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	5,101,023,014円
たわらノーロード バランス(堅実型)	238,426,870円
たわらノーロード バランス(標準型)	573,598,715円
たわらノーロード バランス(積極型)	258,981,901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)	11,831,476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)	486,880,672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)	497,950,691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)	117,687,444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)	16,539,059円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	3,128,349円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,457,850円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	14,807,831円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,931,075円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,037,220円
投資のソムリエ	88,375,585,134円
投資のソムリエ<DC年金>	8,190,359,631円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,610,113,834円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	61,060,887,519円
ワールドアセットバランス(基本コース)	3,323,348,254円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,756,892,516円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	68,858,477円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	38,378,161円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	62,864,043円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	146,255,483円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	30,299,163,589円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,201,813,056円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,903,099円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,330,381円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,653,526円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,975,175,686円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	5,943,085,380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)	523,716,670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)	55,362,483円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	424,050,242円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	927,524,448円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,100,311,798円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	12,860,808円
DIAM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)	2,045,914,615円
DIAM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)	2,183,735,880円
DIAM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)	2,887,293,805円
DIAM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)	115,973,478円
計	247,701,694,163円
2. 受益権の総数	247,701,694,163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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,153,886,022
合計	2,153,886,022

(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(令和2年6月23日から令和2年7月13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	令和2年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	363,335,927,953	-	361,644,395,088	1,691,532,865
アメリカ・ドル	165,809,893,572	-	164,235,245,760	1,574,647,812
イギリス・ポンド	23,217,545,255	-	23,506,617,512	289,072,257
イスラエル・シケル	1,413,384,807	-	1,399,808,151	13,576,656
オーストラリア・ドル	7,978,499,437	-	7,974,144,846	4,354,591
カナダ・ドル	6,767,988,558	-	6,720,099,534	47,889,024
シンガポール・ドル	1,635,095,798	-	1,625,711,976	9,383,822
スウェーデン・クローナ	1,014,430,064	-	1,017,077,796	2,647,732
デンマーク・クローネ	1,879,565,786	-	1,876,090,620	3,475,166
ノルウェー・クローネ	768,503,841	-	777,013,965	8,510,124
ポーランド・ズロチ	2,217,818,489	-	2,202,493,703	15,324,786
マレーシア・リンギット	1,443,836,163	-	1,439,400,600	4,435,563
メキシコ・ペソ	2,718,630,343	-	2,761,130,405	42,500,062
ユーロ	146,470,735,840	-	146,109,560,220	361,175,620
合計	363,335,927,953	-	361,644,395,088	1,691,532,865

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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)

	令和2年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.4762円
(1万口当たり純資産額)	(14,762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

令和2年7月13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 0.125 04/30/22	5,670,000.000	5,667,342.180	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,617,189.800	
		US T N/B 0.125 05/31/22	8,000,000.000	7,994,062.480	
		US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,146,831.530	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,500,000.000	4,492,265.620	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,280,000.000	3,272,312.500	
		US T N/B 0.375 03/31/22	14,270,000.000	14,324,626.980	
		US T N/B 0.375 04/30/25	1,230,000.000	1,235,261.070	
		US T N/B 0.5 03/15/23	7,000,000.000	7,060,702.600	
		US T N/B 0.5 05/31/27	7,960,000.000	7,973,059.330	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,740,000.000	2,769,165.930	
		US T N/B 0.625 05/15/30	7,580,000.000	7,574,818.380	
		US T N/B 1.125 02/28/22	10,000,000.000	10,158,398.000	
		US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	8,095,514.060	
		US T N/B 1.125 05/15/40	4,700,000.000	4,717,625.000	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	434,971.870	
		US T N/B 1.25 05/15/50	9,000,000.000	8,834,062.500	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,671,687.500	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,644,375.000	
		US T N/B 1.375 01/31/25	960,000.000	1,007,774.990	
		US T N/B 1.375 02/15/23	2,870,000.000	2,959,575.360	
		US T N/B 1.375 06/30/23	1,390,000.000	1,439,192.960	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	9,854,023.390	
		US T N/B 1.375 08/31/26	6,000,000.000	6,347,812.500	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	9,343,125.000	
		US T N/B 1.5 01/31/27	8,790,000.000	9,388,131.980	
		US T N/B 1.5 02/15/30	11,550,000.000	12,501,972.590	
		US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,886,700.000	
		US T N/B 1.5 03/31/23	3,810,000.000	3,947,517.180	
		US T N/B 1.5 08/15/22	11,300,000.000	11,616,488.250	
		US T N/B 1.5 08/15/26	8,500,000.000	9,065,117.130	
		US T N/B 1.5 08/31/21	10,560,000.000	10,720,050.000	
		US T N/B 1.5 09/15/22	8,410,000.000	8,655,401.100	
		US T N/B 1.5 09/30/21	20,880,000.000	21,216,853.070	
US T N/B 1.5 10/31/21	9,100,000.000	9,253,206.960			
US T N/B 1.5 11/30/21	2,460,000.000	2,504,299.210			
US T N/B 1.5 11/30/24	1,510,000.000	1,591,516.390			
US T N/B 1.625 02/15/26	12,850,000.000	13,751,507.810			
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,121,406.250			
US T N/B 1.625 05/15/26	14,030,000.000	15,040,598.420			
US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,520,795.300			

US T N/B 1.625 08/15/29	9,900,000.000	10,810,335.880	
US T N/B 1.625 08/31/22	3,280,000.000	3,382,243.730	
US T N/B 1.625 09/30/26	820,000.000	881,179.680	
US T N/B 1.625 10/31/23	1,780,000.000	1,863,854.670	
US T N/B 1.625 10/31/26	100,000.000	107,500.000	
US T N/B 1.625 11/15/22	20,000,000.000	20,682,031.200	
US T N/B 1.625 11/30/26	310,000.000	333,419.520	
US T N/B 1.625 12/15/22	8,600,000.000	8,904,695.240	
US T N/B 1.625 12/31/21	3,070,000.000	3,136,016.970	
US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,509,756.250	
US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,769,062.500	
US T N/B 1.75 03/31/22	5,290,000.000	5,432,168.750	
US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,286,474.600	
US T N/B 1.75 05/15/23	20,000,000.000	20,890,625.000	
US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,772,475.730	
US T N/B 1.75 06/15/22	3,700,000.000	3,813,746.060	
US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,321,250.000	
US T N/B 1.75 06/30/24	7,510,000.000	7,958,839.800	
US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	3,033,597.630	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,360,000.000	5,548,437.500	
US T N/B 1.75 11/15/29	13,240,000.000	14,630,200.000	
US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,409,648.430	
US T N/B 1.75 12/31/24	600,000.000	639,515.620	
US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,406,353.120	
US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	7,019,015.590	
US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,507,481.250	
US T N/B 1.875 04/30/22	10,390,000.000	10,709,005.410	
US T N/B 1.875 06/30/26	6,470,000.000	7,038,652.310	
US T N/B 1.875 07/31/22	10,290,000.000	10,650,953.850	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	7,809,525.000	
US T N/B 1.875 09/30/22	8,860,000.000	9,195,018.750	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	10,294,140.600	
US T N/B 2.0 02/15/23	9,070,000.000	9,498,699.170	
US T N/B 2.0 02/15/25	10,340,000.000	11,152,659.370	
US T N/B 2.0 02/15/50	10,350,000.000	12,093,328.120	
US T N/B 2.0 04/30/24	2,060,000.000	2,198,406.250	
US T N/B 2.0 05/31/24	6,910,000.000	7,382,363.240	
US T N/B 2.0 06/30/24	7,540,000.000	8,068,978.120	
US T N/B 2.0 08/15/25	9,350,000.000	10,147,671.870	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,460,562.500	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	8,091,636.690	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	9,771,921.870	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,544,935.870	
US T N/B 2.125 02/29/24	3,330,000.000	3,561,539.060	
US T N/B 2.125 03/31/24	6,900,000.000	7,390,007.770	
US T N/B 2.125 05/15/25	7,190,000.000	7,821,933.550	
US T N/B 2.125 05/31/26	6,070,000.000	6,684,113.250	
US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,968,025.000	
US T N/B 2.125 07/31/24	3,520,000.000	3,787,574.980	

US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	10,035,812.500	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	4,293,492.940	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	7,196,875.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	14,152,851.490	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	4,052,868.750	
US T N/B 2.25 02/15/27	6,690,000.000	7,475,029.680	
US T N/B 2.25 03/31/26	10,580,000.000	11,704,125.000	
US T N/B 2.25 04/15/22	8,560,000.000	8,872,640.560	
US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,613,750.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	9,290,000.000	10,436,734.370	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,560,000.000	7,921,712.460	
US T N/B 2.25 08/15/49	7,730,000.000	9,476,496.870	
US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,949,025.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	13,850,000.000	15,041,316.330	
US T N/B 2.25 11/15/25	11,510,000.000	12,676,286.650	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,060,000.000	13,588,228.120	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,928,852.320	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,914,603.110	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	6,252,671.840	
US T N/B 2.375 03/15/22	3,000,000.000	3,110,507.790	
US T N/B 2.375 04/30/26	8,680,000.000	9,674,131.250	
US T N/B 2.375 05/15/27	8,430,000.000	9,516,679.680	
US T N/B 2.375 05/15/29	10,760,000.000	12,425,278.060	
US T N/B 2.375 08/15/24	14,120,000.000	15,349,984.300	
US T N/B 2.375 11/15/49	7,470,000.000	9,404,029.680	
US T N/B 2.5 01/15/22	14,320,000.000	14,819,521.830	
US T N/B 2.5 01/31/24	10,750,000.000	11,620,917.910	
US T N/B 2.5 01/31/25	5,160,000.000	5,680,031.240	
US T N/B 2.5 02/15/22	7,160,000.000	7,423,745.250	
US T N/B 2.5 02/15/45	5,690,000.000	7,132,948.430	
US T N/B 2.5 02/15/46	4,320,000.000	5,443,200.000	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	6,177,225.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	7,144,200.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	12,970,000.000	14,095,755.400	
US T N/B 2.5 05/15/46	5,890,000.000	7,430,257.960	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	7,178,945.270	
US T N/B 2.625 01/31/26	8,050,000.000	9,053,105.420	
US T N/B 2.625 02/15/29	7,260,000.000	8,512,350.000	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,370,000.000	1,458,193.750	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,915,223.430	
US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,414,492.140	
US T N/B 2.625 12/15/21	11,320,000.000	11,711,335.900	
US T N/B 2.625 12/31/23	9,670,000.000	10,479,862.500	
US T N/B 2.625 12/31/25	7,300,000.000	8,197,671.870	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	13,007,428.120	
US T N/B 2.75 02/15/28	6,640,000.000	7,748,050.000	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	7,006,470.310	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	11,436,906.250	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	4,167,059.350	

US T N/B 2.75 06/30/25	8,100,000.000	9,075,796.870	
US T N/B 2.75 07/31/23	10,070,000.000	10,855,145.310	
US T N/B 2.75 08/15/42	4,000,000.000	5,204,374.990	
US T N/B 2.75 08/15/47	8,980,000.000	11,939,892.140	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,591,850.740	
US T N/B 2.75 08/31/25	8,140,000.000	9,148,596.870	
US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	3,050,071.850	
US T N/B 2.75 11/15/23	13,330,000.000	14,463,050.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,620,000.000	6,003,834.370	
US T N/B 2.75 11/15/47	4,650,000.000	6,195,035.130	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,740,246.870	
US T N/B 2.875 05/15/28	13,300,000.000	15,705,429.620	
US T N/B 2.875 05/15/43	8,730,000.000	11,576,116.350	
US T N/B 2.875 05/15/49	8,200,000.000	11,301,265.570	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	5,119,105.440	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,990,000.000	3,374,261.700	
US T N/B 2.875 08/15/28	10,270,000.000	12,173,159.370	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,340,000.000	5,806,784.370	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,481,171.870	
US T N/B 2.875 10/15/21	13,100,000.000	13,539,566.300	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	10,107,229.680	
US T N/B 2.875 11/15/21	8,440,000.000	8,748,257.740	
US T N/B 2.875 11/15/46	5,750,000.000	7,775,527.310	
US T N/B 2.875 11/30/23	9,810,000.000	10,695,199.160	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,780,000.000	7,695,829.650	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,460,000.000	8,943,062.500	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,600,000.000	9,198,750.000	
US T N/B 3.0 02/15/49	7,830,000.000	11,006,655.420	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	3,119,943.750	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,560,000.000	6,215,137.500	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,000,000.000	8,319,374.990	
US T N/B 3.0 08/15/48	7,030,000.000	9,838,155.420	
US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	8,458,590.620	
US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	7,479,937.460	
US T N/B 3.0 11/15/44	4,400,000.000	5,979,531.220	
US T N/B 3.0 11/15/45	4,950,000.000	6,773,765.620	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,960,000.000	4,070,462.500	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	6,547,603.070	
US T N/B 3.125 05/15/48	6,660,000.000	9,498,825.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	3,930,000.000	5,438,137.500	
US T N/B 3.125 11/15/28	9,770,000.000	11,817,883.540	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	3,222,988.250	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,110,000.000	8,768,804.680	
US T N/B 3.375 11/15/48	7,560,000.000	11,304,562.500	
US T N/B 3.5 02/15/39	3,170,000.000	4,527,899.180	
US T N/B 3.625 02/15/44	6,540,000.000	9,718,542.140	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,350,000.000	6,445,816.380	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,170,000.000	1,745,128.120	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,190,000.000	6,325,917.940	

	US T N/B 3.875 08/15/40	1,460,000.000	2,199,581.250	
	US T N/B 4.25 05/15/39	690,000.000	1,076,022.650	
	US T N/B 4.25 11/15/40	1,040,000.000	1,642,631.240	
	US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,895,635.140	
	US T N/B 4.375 05/15/40	1,840,000.000	2,936,381.240	
	US T N/B 4.375 05/15/41	3,150,000.000	5,067,070.310	
	US T N/B 4.375 11/15/39	3,620,000.000	5,747,598.410	
	US T N/B 4.5 02/15/36	2,320,000.000	3,574,431.230	
	US T N/B 4.5 05/15/38	2,250,000.000	3,578,554.680	
	US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	4,035,609.370	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	4,568,951.930	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,470,000.000	2,465,235.930	
	US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,470,307.800	
	US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,158,433.580	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,355,164.050	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,200,000.000	1,786,359.350	
	US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,297,785.920	
	US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,050,156.230	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,890,660.130	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,210,000.000	1,866,519.500	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,424,437.490	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,320,581.990	
アメリカ・ドル	小計	1,365,120,000.000 (145,849,420,800)	1,528,648,180.560 (163,320,771,614)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/31/23	3,000,000.000	3,014,940.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,700,000.000	1,732,300.000	
	UK TREASURY 0.5 07/22/22	3,480,000.000	3,523,569.600	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	2,080,000.000	2,152,009.600	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	2,300,000.000	2,301,610.000	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	2,090,000.000	2,144,737.100	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,440,000.000	1,544,080.320	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	6,690,000.000	6,971,247.600	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,860,000.000	4,201,687.200	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,000,000.000	1,130,600.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,390,000.000	2,616,524.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,890,000.000	3,520,887.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	3,240,000.000	3,668,944.890	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,600,000.000	2,109,594.230	

UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,920,000.000	2,936,179.200	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,320,000.000	3,004,400.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	2,680,000.000	3,733,776.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	7,000,000.000	7,280,910.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	3,860,000.000	4,648,984.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	4,330,000.000	4,805,252.140	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,830,000.000	4,114,798.390	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,670,000.000	4,758,794.400	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,797,296.720	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	4,380,000.000	6,892,368.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	3,190,000.000	5,272,751.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,400,000.000	5,422,800.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,280,000.000	4,377,600.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,480,000.000	5,520,728.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,260,000.000	5,145,258.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,580,000.000	5,252,218.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,930,000.000	3,236,224.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,280,000.000	2,998,450.800	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,360,000.000	5,739,888.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,520,000.000	6,624,640.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,930,000.000	3,812,715.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	4,020,000.000	8,727,420.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,320,000.000	5,217,048.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,310,000.000	6,020,559.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	3,120,000.000	4,601,376.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,480,000.000	4,335,784.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,780,000.000	3,438,304.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,169,040.500	
イギリス・ボンド 小計	123,940,000.000 (16,730,660,600)	173,518,294.890 (23,423,234,627)	

イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	5,400,000.000	5,543,434.800	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	5,210,000.000	5,588,798.260	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	6,700,000.000	7,398,923.900	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,000,000.000	3,412,365.000	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,500,000.000	2,823,680.000	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,730,000.000	2,547,826.360	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	7,960,000.000	8,842,557.040	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	4,670,000.000	8,311,511.890	
イスラエル・シュケル 小計		37,170,000.000 (1,148,181,300)	44,469,097.250 (1,373,650,414)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	3,210,000.000	3,194,029.150	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	4,500,000.000	4,539,603.150	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,000,000.000	1,030,857.300	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	3,520,000.000	3,727,846.130	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,340,000.000	4,846,912.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	5,730,000.000	5,998,647.020	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	5,450,000.000	6,293,138.430	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	5,220,000.000	5,696,465.940	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	950,000.000	1,142,209.220	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	2,620,000.000	3,179,079.440	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,270,000.000	4,909,646.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	5,590,000.000	6,494,848.820	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	5,620,000.000	6,581,582.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,020,000.000	2,549,138.170	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	5,420,000.000	6,150,818.150	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	4,680,000.000	5,658,054.480	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,370,000.000	1,765,514.330	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	2,050,000.000	2,790,654.750	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,200,000.000	6,313,513.430	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,890,000.000	4,102,539.630	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	5,540,000.000	7,075,288.560		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	7,140,000.000	8,173,677.780		
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,040,000.000	4,483,466.760		
オーストラリア・ドル 小計		92,370,000.000 (6,856,625,100)	106,697,530.640 (7,920,157,699)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	920,000.000	1,392,686.800	
	CANADA 0.25 08/01/22	1,600,000.000	1,598,960.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	4,170,000.000	4,189,056.900	
	CANADA 0.5 09/01/25	4,370,000.000	4,403,649.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,620,000.000	2,726,319.600	

	CANADA 1.0 09/01/22	3,180,000.000	3,231,166.200	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,060,000.000	2,147,426.400	
	CANADA 1.25 06/01/30	3,320,000.000	3,545,428.000	
	CANADA 1.25 11/01/21	4,300,000.000	4,358,695.000	
	CANADA 1.5 02/01/22	3,050,000.000	3,110,634.000	
	CANADA 1.5 05/01/22	1,920,000.000	1,963,910.400	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,130,000.000	3,239,424.800	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,450,000.000	2,613,170.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	1,410,000.000	1,478,540.100	
	CANADA 1.75 03/01/23	5,070,000.000	5,266,817.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,660,000.000	1,859,349.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	3,080,000.000	3,244,040.800	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,290,000.000	2,864,698.400	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,190,000.000	3,414,033.700	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,840,000.000	2,010,494.400	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,480,000.000	1,707,594.400	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,000,000.000	2,168,760.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,350,000.000	1,413,882.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,840,000.000	4,020,531.200	
	CANADA 2.75 12/01/64	670,000.000	1,069,266.400	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,510,000.000	3,886,182.800	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,450,000.000	3,841,747.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,950,000.000	3,213,268.500	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,230,000.000	1,792,269.900	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,860,000.000	3,009,852.000	
	カナダ・ドル 小計	73,970,000.000 (5,817,740,500)	84,781,855.500 (6,668,092,935)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,700,000.000	1,764,398.540	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	1,740,000.000	1,786,249.200	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	330,000.000	382,285.200	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	580,000.000	613,886.960	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	570,000.000	620,885.490	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	510,000.000	591,610.200	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	920,000.000	1,003,609.600	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	470,000.000	563,433.650	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,020,000.000	1,161,051.300	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,100,000.000	1,459,639.140	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	730,000.000	938,586.980	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,070,000.000	1,147,802.910	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,070,000.000	1,253,676.200	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	650,000.000	770,412.030	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,970,000.000	2,180,630.600	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,670,000.000	1,773,040.160	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,100,000.000	1,408,758.440	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,130,000.000	1,336,104.420		
	シンガポール・ドル 小計	18,330,000.000 (1,409,393,700)	20,756,061.020 (1,595,933,532)	

スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	11,710,000.000	12,589,453.760	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	7,310,000.000	7,900,940.400	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,810,000.000	5,201,167.460	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	15,060,000.000	16,002,846.360	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	17,950,000.000	20,441,998.500	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	7,780,000.000	12,076,116.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	14,810,000.000	15,890,864.900	
スウェーデン・クローナ 小計		79,430,000.000 (922,182,300)	90,103,387.380 (1,046,100,327)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	12,200,000.000	12,447,660.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	16,390,000.000	17,555,230.660	
	DENMARK 0.5 11/15/29	10,040,000.000	10,862,175.600	
	DENMARK 1.5 11/15/23	15,100,000.000	16,177,430.300	
	DENMARK 1.75 11/15/25	14,100,000.000	15,859,947.900	
	DENMARK 4.5 11/15/39	22,050,000.000	41,741,320.260	
デンマーク・クローネ 小計		89,880,000.000 (1,458,752,400)	114,643,764.720 (1,860,668,301)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	7,410,000.000	7,970,047.800	
	NORWAY 1.5 02/19/26	8,270,000.000	8,805,102.080	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,870,000.000	3,119,411.030	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,070,000.000	10,753,861.730	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,470,000.000	3,837,976.150	
	NORWAY 2.0 04/26/28	10,510,000.000	11,718,650.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	8,060,000.000	8,478,515.500	
	NORWAY 3.0 03/14/24	11,760,000.000	12,961,284.000	
ノルウェー・クローネ 小計		62,420,000.000 (706,594,400)	67,644,848.290 (765,739,683)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 07/25/22	2,640,000.000	2,636,287.070	
	POLAND 2.25 04/25/22	7,840,000.000	8,146,450.700	
	POLAND 2.25 10/25/24	6,880,000.000	7,387,784.580	
	POLAND 2.5 01/25/23	9,120,000.000	9,659,720.660	
	POLAND 2.5 04/25/24	4,850,000.000	5,234,804.320	
	POLAND 2.5 07/25/26	6,060,000.000	6,614,525.750	
	POLAND 2.5 07/25/27	6,230,000.000	6,823,445.480	
	POLAND 2.75 04/25/28	5,790,000.000	6,457,008.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	4,930,070.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	7,180,000.000	8,071,594.440	
	POLAND 4.0 10/25/23	1,610,000.000	1,804,616.800	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,478,764.690	
	POLAND 5.75 09/23/22	8,690,000.000	9,767,907.600	
ポーランド・ズロチ 小計		73,050,000.000 (1,978,194,000)	80,012,980.090 (2,166,751,501)	
マレーシア・リ ンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	5,147,327.500	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	4,057,777.260	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,890,863.370	

	MALAYSIA 3.795 09/30/22	1,790,000.000	1,860,364.000	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	3,700,000.000	3,890,792.720	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,000,000.000	2,160,597.200	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,443,324.850	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	2,760,000.000	3,033,703.120	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,637,900.250	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,777,828.000	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	1,840,000.000	1,974,529.200	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,311,117.110	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,354,487.390	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	2,246,315.400	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,645,933.010	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	3,231,317.580	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,050,000.000	1,222,994.640	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	3,500,000.000	4,026,990.450	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	5,540,000.000	6,542,980.990	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	4,097,244.830	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,760,776.860	
マレーシア・リングギット 小計		57,530,000.000 (1,441,701,800)	63,315,165.730 (1,586,678,053)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	62,560,000.000	65,778,712.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	10,473,000.000	14,369,898.570	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	31,873,000.000	38,232,300.960	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	38,064,000.000	39,049,476.960	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	66,079,000.000	68,281,168.570	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	43,175,000.000	48,176,392.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	9,315,000.000	10,677,691.350	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	26,328,000.000	29,544,228.480	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	20,241,000.000	23,359,733.280	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	40,030,000.000	44,660,270.100	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	33,666,000.000	38,644,864.740	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	36,863,000.000	40,560,358.900	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	48,201,000.000	57,540,425.760	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	37,143,000.000	44,971,258.680	
	メキシコ・ペソ 小計		504,011,000.000 (2,394,052,250)	563,846,780.350 (2,678,272,207)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	440,000.000	451,395.340	

AUSTRIA 0.0 04/20/23	1,000,000.000	1,016,884.000	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	2,840,000.000	3,045,272.360	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,449,207.900	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,300,000.000	1,414,224.760	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	760,000.000	866,753.400	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,150,000.000	1,240,146.200	
AUSTRIA 07/15/23	850,000.000	865,342.500	
AUSTRIA 07/15/24	2,670,000.000	2,732,718.300	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,470,000.000	1,607,087.790	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,450,000.000	1,933,094.860	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	400,000.000	622,960.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,990,000.000	2,184,245.890	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	870,000.000	937,948.990	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,020,000.000	2,074,294.440	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,890,000.000	2,542,159.620	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	980,000.000	1,679,643.060	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	2,460,000.000	2,695,959.730	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,840,000.000	5,071,352.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	700,000.000	753,130.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	660,000.000	1,540,781.880	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,420,000.000	4,089,800.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,700,000.000	2,227,321.300	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,708,865.600	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,410,000.000	1,443,854.100	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,770,000.000	1,816,905.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	2,030,000.000	2,083,490.500	
BELGIUM 0.4 06/22/40	1,640,000.000	1,657,113.400	
BELGIUM 0.5 10/22/24	1,170,000.000	1,222,775.420	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,590,134.570	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,930,000.000	2,085,673.800	
BELGIUM 0.8 06/22/28	3,390,000.000	3,689,676.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	2,070,000.000	2,283,007.540	
BELGIUM 1.0 06/22/26	3,770,000.000	4,094,837.520	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,610,000.000	1,805,071.940	
BELGIUM 1.25 04/22/33	350,000.000	407,389.810	
BELGIUM 1.45 06/22/37	1,000,000.000	1,205,975.600	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,640,000.000	2,086,450.770	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,550,000.000	2,041,065.570	
BELGIUM 1.9 06/22/38	1,930,000.000	2,488,794.830	
BELGIUM 2.15 06/22/66	1,110,000.000	1,778,109.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,680,000.000	1,822,845.360	
BELGIUM 2.25 06/22/57	1,400,000.000	2,162,296.070	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,490,000.000	2,803,931.730	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,420,000.000	2,003,111.640	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,670,000.000	2,965,118.400	
BELGIUM 4.0 03/28/22	3,190,000.000	3,444,865.050	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,292,251.600	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,350,000.000	4,171,734.100	
BELGIUM 4.25 09/28/21	4,480,000.000	4,743,046.770	

BELGIUM 4.25 09/28/22	1,350,000.000	1,496,770.650	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,220,000.000	2,855,457.240	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,950,000.000	5,067,639.800	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,750,000.000	5,456,278.490	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	5,300,000.000	5,480,369.600	
BUNDESOBL 04/05/24	5,380,000.000	5,528,056.520	
BUNDESOBL 04/08/22	3,300,000.000	3,339,633.000	
BUNDESOBL 04/14/23	2,960,000.000	3,020,632.640	
BUNDESOBL 10/07/22	3,350,000.000	3,404,364.800	
BUNDESOBL 10/08/21	3,400,000.000	3,427,982.000	
BUNDESOBL 10/13/23	4,800,000.000	4,915,920.000	
BUNDESOBL 10/18/24	4,040,000.000	4,164,613.800	
BUNDESSCHAT 0.0 03/11/22	3,000,000.000	3,034,770.000	
BUNDESSCHAT 0.0 09/10/21	1,070,000.000	1,078,344.930	
BUNDESSCHAT 0.0 12/10/21	40,000.000	40,383.600	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,790,000.000	2,930,225.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	2,000,000.000	2,086,600.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,080,000.000	2,117,623.240	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	5,740,000.000	6,096,568.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	6,990,000.000	7,501,038.900	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	5,940,000.000	6,360,908.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	4,750,000.000	5,020,892.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,250,000.000	6,676,875.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,040,000.000	2,219,499.600	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	5,360,000.000	5,808,208.560	
DEUTSCHLAND 08/15/26	5,690,000.000	5,932,939.650	
DEUTSCHLAND 08/15/29	5,620,000.000	5,905,560.060	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,321,848.400	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	4,870,000.000	5,302,017.700	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	3,930,000.000	5,417,686.950	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,050,000.000	5,345,914.850	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	8,090,000.000	8,609,232.380	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	5,000,000.000	5,434,309.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,459,654.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	4,200,000.000	4,580,311.670	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	4,380,000.000	4,594,427.280	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	6,230,000.000	6,482,439.600	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,880,000.000	4,212,325.880	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	4,660,000.000	7,691,889.200	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	5,810,000.000	9,838,959.590	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	3,130,000.000	5,562,917.700	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,750,000.000	8,213,617.810	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,150,000.000	5,914,471.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,589,120.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,520,000.000	4,383,489.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,130,000.000	8,363,084.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	4,320,000.000	7,104,801.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,440,000.000	5,087,863.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,469,749.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,327,696.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,522,034.000	
FINLAND 0.0 09/15/24	850,000.000	871,393.650	
FINLAND 0.125 04/15/36	360,000.000	367,398.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	520,000.000	550,657.640	
FINLAND 0.5 09/15/27	1,160,000.000	1,238,710.640	
FINLAND 0.5 09/15/28	300,000.000	321,596.400	
FINLAND 0.5 09/15/29	880,000.000	945,281.920	
FINLAND 0.75 04/15/31	610,000.000	673,990.220	
FINLAND 0.875 09/15/25	780,000.000	838,433.700	
FINLAND 04/15/22	1,010,000.000	1,021,453.400	
FINLAND 09/15/23	570,000.000	581,447.880	
FINLAND 1.125 04/15/34	1,510,000.000	1,761,141.690	
FINLAND 1.375 04/15/47	760,000.000	1,006,776.690	
FINLAND 1.5 04/15/23	890,000.000	942,510.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	780,000.000	818,844.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	1,200,000.000	1,320,043.200	
FINLAND 2.625 07/04/42	950,000.000	1,481,968.650	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,180,000.000	1,479,567.780	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,440,000.000	1,774,447.200	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,858,800.520	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	8,900,000.000	9,081,248.500	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	6,430,000.000	6,711,473.250	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	7,840,000.000	8,238,930.560	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	12,820,000.000	13,560,739.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	6,690,000.000	7,147,395.300	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,000,000.000	1,043,235.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	6,000,000.000	6,517,500.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,030,000.000	3,208,628.490	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	6,690,000.000	7,284,935.010	
FRANCE OAT 02/25/22	2,810,000.000	2,838,153.950	
FRANCE OAT 03/25/23	5,230,000.000	5,316,514.660	
FRANCE OAT 03/25/24	10,170,000.000	10,390,638.150	
FRANCE OAT 03/25/25	3,610,000.000	3,699,143.890	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,564,009.000	

FRANCE OAT 1.0 05/25/27	6,120,000.000	6,713,419.680	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	8,080,000.000	8,740,944.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	6,760,000.000	7,911,872.900	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	5,030,000.000	5,930,873.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	7,930,000.000	9,359,041.510	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	4,480,000.000	5,721,632.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	9,570,000.000	10,222,635.720	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,070,000.000	3,002,452.200	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	5,110,000.000	6,568,905.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	4,780,000.000	6,719,594.940	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	8,220,000.000	9,129,140.220	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	5,090,000.000	5,425,507.350	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	6,890,000.000	8,748,995.710	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,800,000.000	5,914,185.600	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	13,130,000.000	13,982,924.800	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	4,320,000.000	7,253,979.840	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,090,000.000	4,293,199.380	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	7,840,000.000	9,670,640.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,610,000.000	5,452,551.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,460,000.000	5,439,047.700	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	5,170,000.000	8,744,693.100	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	10,990,000.000	12,764,643.220	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	6,240,000.000	11,582,688.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,270,000.000	7,251,527.500	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	7,440,000.000	11,277,075.840	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,120,000.000	8,828,071.420	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,996,167.500	
IRISH 0.2 05/15/27	570,000.000	588,027.960	
IRISH 0.4 05/15/35	2,770,000.000	2,858,748.580	
IRISH 0.8 03/15/22	620,000.000	634,255.100	
IRISH 0.9 05/15/28	1,970,000.000	2,143,312.720	
IRISH 1.0 05/15/26	1,700,000.000	1,834,833.800	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.000	925,816.870	
IRISH 1.35 03/18/31	1,180,000.000	1,354,073.800	
IRISH 1.5 05/15/50	770,000.000	966,945.980	
IRISH 1.7 05/15/37	1,130,000.000	1,399,551.330	
IRISH 10/18/22	2,500,000.000	2,531,180.500	
IRISH 2.0 02/18/45	1,400,000.000	1,918,815.610	
IRISH 2.4 05/15/30	1,680,000.000	2,091,154.800	
IRISH 3.4 03/18/24	1,510,000.000	1,727,205.190	
IRISH 3.9 03/20/23	1,400,000.000	1,568,306.600	
IRISH 5.4 03/13/25	1,530,000.000	1,949,673.490	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	3,180,000.000	3,170,310.540	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	3,800,000.000	3,820,197.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	2,000,000.000	2,021,000.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,890,757.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	2,000,000.000	1,995,400.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	3,048,300.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	5,000,000.000	5,096,750.000	

ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,752,650.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,680,000.000	1,638,000.000	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	3,050,000.000	3,105,586.250	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,752,650.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,589,530.000	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	4,220,000.000	4,283,738.880	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	3,067,224.000	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	3,070,000.000	2,999,390.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	5,800,000.000	6,021,357.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,258,139.040	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,908,886.400	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,550,000.000	2,656,551.750	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,456,750.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	4,320,000.000	4,457,137.100	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,140,000.000	4,342,359.060	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,949,520.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	3,290,000.000	3,527,827.520	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	3,098,180.200	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,000,000.000	5,373,350.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,620,000.000	1,740,643.020	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,010,000.000	2,072,832.600	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,711,250.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,597,520.000	
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	3,300,000.000	3,397,762.500	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	3,650,000.000	4,062,486.500	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	2,210,000.000	2,354,534.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	3,030,000.000	3,236,646.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,430,000.000	3,751,202.350	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,290,000.000	5,728,239.470	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	3,340,000.000	3,760,840.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,600,000.000	1,803,360.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	10,110,000.000	11,504,280.210	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,130,000.000	2,496,360.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,400,000.000	5,102,850.720	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,130,000.000	2,552,006.250	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,850,000.000	4,738,934.200	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	3,370,000.000	4,127,495.120	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	2,950,000.000	3,766,533.450	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	4,660,000.000	5,631,735.820	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	6,380,000.000	7,210,548.400	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,860,000.000	2,542,806.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,390,000.000	5,791,727.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	4,012,876.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,500,000.000	4,214,000.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	4,430,000.000	4,956,284.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,240,000.000	2,542,624.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	4,840,000.000	6,227,124.640	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,590,000.000	3,908,427.840	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,810,000.000	5,202,977.000	

ITALY BTPS 5.0 03/01/25	8,750,000.000	10,503,224.370	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,800,000.000	2,566,800.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,660,000.000	4,000,640.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,210,000.000	4,839,396.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,850,000.000	3,875,715.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,300,068.480	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,610,000.000	4,050,788.220	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	6,440,000.000	9,579,500.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,311,110.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,705,940.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,990,865.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,183,140.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,700,000.000	3,823,853.800	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	3,560,000.000	3,713,692.320	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	3,250,000.000	3,442,677.860	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,570,000.000	1,750,017.440	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	740,000.000	787,508.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	3,370,000.000	3,668,797.680	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,660,000.000	1,823,480.450	
NETHERLANDS 01/15/22	5,190,000.000	5,239,536.460	
NETHERLANDS 01/15/24	3,030,000.000	3,098,871.900	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	3,420,000.000	3,669,621.340	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,600,000.000	3,985,445.510	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,050,000.000	1,111,896.450	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,800,000.000	2,432,363.400	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	2,700,000.000	4,708,501.090	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,856,372.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,710,000.000	4,971,259.230	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,260,000.000	3,829,344.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	3,020,000.000	4,397,724.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	712,071.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	2,370,000.000	2,392,989.000	
SPAIN 0.05 10/31/21	6,080,000.000	6,119,556.480	
SPAIN 0.25 07/30/24	2,450,000.000	2,501,280.950	
SPAIN 0.35 07/30/23	3,300,000.000	3,368,260.500	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,348,840.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	3,040,000.000	3,100,006.560	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,530,000.000	2,570,300.370	
SPAIN 0.6 10/31/29	4,720,000.000	4,856,006.800	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,390,000.000	1,321,746.830	

SPAIN 1.2 10/31/40	2,000,000.000	2,082,344.000	
SPAIN 1.25 10/31/30	3,170,000.000	3,442,303.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	4,000,000.000	4,335,244.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,010,000.000	2,205,165.770	
SPAIN 1.4 07/30/28	2,460,000.000	2,701,572.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	5,320,000.000	5,874,687.670	
SPAIN 1.45 10/31/27	6,450,000.000	7,076,617.500	
SPAIN 1.5 04/30/27	3,700,000.000	4,067,410.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,270,000.000	2,465,347.120	
SPAIN 1.85 07/30/35	2,270,000.000	2,639,426.150	
SPAIN 1.95 04/30/26	5,990,000.000	6,699,605.350	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,970,000.000	3,436,420.680	
SPAIN 2.15 10/31/25	4,650,000.000	5,213,426.550	
SPAIN 2.35 07/30/33	3,400,000.000	4,151,060.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	3,230,000.000	4,426,950.790	
SPAIN 2.75 10/31/24	3,930,000.000	4,439,520.570	
SPAIN 2.9 10/31/46	2,990,000.000	4,200,544.250	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,960,000.000	3,309,934.710	
SPAIN 3.8 04/30/24	5,600,000.000	6,474,627.030	
SPAIN 4.2 01/31/37	4,460,000.000	6,854,462.500	
SPAIN 4.4 10/31/23	4,080,000.000	4,721,478.400	
SPAIN 4.65 07/30/25	4,820,000.000	5,995,969.140	
SPAIN 4.7 07/30/41	3,800,000.000	6,512,935.510	
SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,546,438.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,300,000.000	3,974,630.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	6,207,957.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	2,440,000.000	4,575,058.560	
SPAIN 5.4 01/31/23	3,740,000.000	4,293,370.400	
SPAIN 5.75 07/30/32	4,820,000.000	7,785,951.810	
SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,568,973.760	
SPAIN 5.9 07/30/26	4,440,000.000	6,040,446.840	
SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,209,897.690	
ユーロ 小計	1,003,380,000.000 (121,288,574,400)	1,199,400,888.970 (144,983,579,459)	
国債証券 合計	308,002,073,550 (308,002,073,550)	359,389,630,352 (359,389,630,352)	
合計		359,389,630,352 (359,389,630,352)	

(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 210銘柄	44.67	45.44
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	6.41	6.52
イスラエル・シケル	国債証券 8銘柄	0.38	0.38

オーストラリア・ドル	国債証券	23銘柄	2.17	2.20
カナダ・ドル	国債証券	30銘柄	1.82	1.86
シンガポール・ドル	国債証券	18銘柄	0.44	0.44
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.29	0.29
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.51	0.52
ノルウェー・クローネ	国債証券	8銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.59	0.60
マレーシア・リンギット	国債証券	21銘柄	0.43	0.44
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.73	0.75
ユーロ	国債証券	304銘柄	39.65	40.34

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,023,550,011
コール・ローン	472,420,221
株式	344,037,314,451
投資信託受益証券	671,399,228
投資証券	7,841,278,624
派生商品評価勘定	203,378,092
未収入金	9,401,146
未収配当金	401,382,299
差入委託証拠金	2,473,224,362
流動資産合計	359,133,348,434
資産合計	
359,133,348,434	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,411,848
未払解約金	66,895,400
流動負債合計	71,307,248
負債合計	
71,307,248	
純資産の部	
元本等	
元本	94,130,088,804
剰余金	
剰余金又は欠損金()	264,931,952,382
元本等合計	359,062,041,186
純資産合計	359,062,041,186
負債純資産合計	359,133,348,434

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
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、計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	令和2年7月13日現在
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	88,107,131,248円
同期中追加設定元本額	20,334,087,635円
同期中一部解約元本額	14,311,130,079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	3,944,608,785円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,268,674円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	8,896,321円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	9,565,894円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	36,089,252円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,985,273円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,013,642円
たわらノーロード 先進国株式	15,236,467,437円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	97,917,091円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,005,202,115円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	312,578,722円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,266,935円
たわらノーロード バランス(標準型)	263,116,415円
たわらノーロード バランス(積極型)	311,430,997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)	989,527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)	119,026,819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)	293,588,912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)	188,207,170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)	319,086,707円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	385,131円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,890,611円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,568,466円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,295,546円
たわらノーロード 全世界株式	63,209,176円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	44,986,805,428円
One DC 先進国株式インデックスファンド	281,160,604円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	195,789,034円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	971,200,821円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,150,165,395円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	124,848,506円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	365,574,704円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	308,740,983円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,179,401円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	834,497,929円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	174,689,647円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	220,653,972円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	179,422,441円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	288,800,808円
投資のソムリエ	1,191,275,386円
クルーズコントロール	324,562,197円
投資のソムリエ<DC年金>	110,575,912円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	207,306,102円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	116,610,198円
クルーズコントロール<DC年金>	321,215円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,533,140円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,677,865円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	80,752,036円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	746,428,570円
ワールドアセットバランス(基本コース)	439,823,625円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	368,873,613円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,111,680円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	633,519円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	770,594円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,167,416円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	29,265,534円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	335,861,496円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	166,913,124円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	305,324円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	133,311円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	137,468円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,050,368円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	73,876,051円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	89,790,365円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	259,611,247円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	85,814,153円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,761,296,608円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,074,383,700円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	205,878,866円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	14,908,067円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	116,747,445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)	58,890,342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)	125,196,985円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,101,766円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	44,069,079円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,299,927円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,185,932円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,532,547円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	56,839,120円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	381,454,108円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	508,369,337円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,633,480,993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)	575,725,817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)	93,601,998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)	614,010,587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)	26,235,047円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,783,514円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	8,920,478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)	208,781,273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)	22,052,824円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	84,491,056円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	147,884,875円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	263,012,859円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	5,107,187円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	222,659円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	255,561円
計	94,130,088,804円
2. 受益権の総数	94,130,088,804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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	15,839,023,474
投資信託受益証券	206,538,262
投資証券	1,511,738,932
合計	17,557,300,668

(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(令和2年2月18日から令和2年7月13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	令和2年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	432,958,917	-	432,923,980	34,937
アメリカ・ドル	313,254,880	-	313,225,560	29,320
イギリス・ポンド	29,428,256	-	29,425,640	2,616
オーストラリア・ドル	9,874,319	-	9,871,260	3,059
カナダ・ドル	18,874,560	-	18,873,600	960
ユーロ	61,526,902	-	61,527,920	1,018
買建	316,645,030	-	316,020,790	624,240
アメリカ・ドル	232,143,125	-	231,500,610	642,515
イギリス・ポンド	15,108,744	-	15,117,760	9,016
オーストラリア・ドル	9,148,740	-	9,129,060	19,680
カナダ・ドル	10,004,933	-	9,987,280	17,653
ユーロ	50,239,488	-	50,286,080	46,592
合計	749,603,947	-	748,944,770	589,303

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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	令和2年7月13日現在			
	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	5,835,441,123	-	6,034,996,670	199,555,547
合計	5,835,441,123	-	6,034,996,670	199,555,547

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 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）

令和2年7月13日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.8145円 (38,145円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年7月13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	35,300	3,200.000	112,960,000.000	
	ABBOTT LABORATORIES	147,327	93.040	13,707,304.080	
	AES CORP	56,917	14.360	817,328.120	
	ABIOMED INC	3,574	264.510	945,358.740	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,209	118.350	8,782,635.150	
	ADVANCED MICRO DEVICES	97,972	55.880	5,474,675.360	
	ADOBE INC	40,249	466.200	18,764,083.800	
	CHUBB LTD	37,578	128.430	4,826,142.540	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,617	273.190	5,085,978.230	
	ALLEGHANY CORP	1,263	488.140	616,520.820	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	168.810	1,021,638.120	
	RALPH LAUREN CORP	3,422	68.980	236,049.560	
	ALLSTATE CORP	27,068	86.970	2,354,103.960	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,633	142.450	8,494,720.850	
	AMGEN INC	48,881	249.040	12,173,324.240	
	HESS CORP	21,951	44.900	985,599.900	

AMERICAN EXPRESS CO	57,195	93.230	5,332,289.850	
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,906	84.150	3,526,389.900	
AFLAC INC	60,919	34.870	2,124,245.530	
AMERICAN INTL GROUP	74,200	30.100	2,233,420.000	
AMERCO	929	293.570	272,726.530	
ANALOG DEVICES	30,476	124.500	3,794,262.000	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,098	108.820	1,969,424.360	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	65,819	33.870	2,229,289.530	
JONES LANG LASALLE INC	4,087	104.370	426,560.190	
VALERO ENERGY CORP	34,559	53.650	1,854,090.350	
ANSYS INC	7,241	301.650	2,184,247.650	
APPLE INC	365,047	383.680	140,061,232.960	
APPLIED MATERIALS INC	76,886	62.590	4,812,294.740	
ALBEMARLE CORP	10,027	78.890	791,030.030	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,888	39.380	1,807,069.440	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	78.260	726,096.280	
AMEREN CORP	21,595	74.540	1,609,691.300	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	66.120	439,764.120	
AUTOLIV INC	5,913	65.540	387,538.020	
AUTODESK INC	18,410	244.240	4,496,458.400	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,591	147.170	5,237,927.470	
AUTOZONE INC	1,930	1,113.590	2,149,228.700	
AVERY DENNISON CORP	6,549	111.040	727,200.960	
BALL CORP	27,584	72.400	1,997,081.600	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	115,682	182.900	21,158,237.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	67,214	38.380	2,579,673.320	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,938	85.230	3,659,605.740	
BECTON DICKINSON & CO	22,720	257.370	5,847,446.400	
AMETEK INC	19,590	86.900	1,702,371.000	
VERIZON COMM INC	345,153	54.490	18,807,386.970	
WR BERKLEY CORP	12,511	57.810	723,260.910	
BEST BUY CO INC	18,980	84.900	1,611,402.000	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,859	477.660	887,969.940	
YUM! BRANDS INC	24,939	87.240	2,175,678.360	
FIRSTENERGY CORP	44,134	41.270	1,821,410.180	
BOEING CO	44,172	178.440	7,882,051.680	
ROBERT HALF INTL INC	11,645	50.680	590,168.600	
BORGWARNER INC	17,210	35.510	611,127.100	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,462	34.680	4,004,222.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,838	82.210	973,201.980	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,830	153.910	1,512,935.300	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,128	819.200	1,743,257.600	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	188,582	57.430	10,830,264.260	
INGREDION INC	5,305	80.900	429,174.500	
ONEOK INC	36,226	26.720	967,958.720	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	59.250	349,575.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	147.830	913,737.230	
SEMPRA ENERGY	24,596	119.170	2,931,105.320	
FEDEX CORP	20,489	158.590	3,249,350.510	
VERISIGN INC	8,769	209.990	1,841,402.310	
AMPHENOL CORP	24,606	94.930	2,335,847.580	
BROWN-FORMAN CORP	26,214	64.800	1,698,667.200	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	5.700	553,675.200	
CSX CORP	65,173	67.540	4,401,784.420	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.600	552,921.600	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	50.280	706,434.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	47.380	930,590.580	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,685	184.930	2,530,767.050	
CARDINAL HEALTH INC	25,815	49.360	1,274,228.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	41,183	16.160	665,517.280	
CATERPILLAR INC	46,755	128.010	5,985,107.550	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	119.450	1,178,374.250	
CITRIX SYSTEMS INC	10,439	152.280	1,589,650.920	
CENTURYLINK INC	80,424	9.910	797,001.840	
CERNER CORP	25,177	69.930	1,760,627.610	
JPMORGAN CHASE & CO	256,480	96.270	24,691,329.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,723	82.780	1,632,669.940	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	70.480	907,218.560	
CINTAS CORP	7,294	266.880	1,946,622.720	
CISCO SYSTEMS INC	354,318	46.660	16,532,477.880	
CLOROX COMPANY	10,586	229.760	2,432,239.360	
COCA-COLA CO/THE	340,451	45.150	15,371,362.650	
COPART INC	16,749	83.050	1,391,004.450	
COGNEX CORP	15,179	62.160	943,526.640	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,822	73.680	5,070,804.960	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,559	88.510	1,996,697.090	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	176.540	918,537.620	
COMERICA INC	11,985	35.770	428,703.450	
NRG ENERGY, INC.	21,039	32.960	693,445.440	
COMCAST CORP-CL A	379,157	40.510	15,359,650.070	
CONAGRA BRANDS INC	40,291	36.310	1,462,966.210	
CONSOLIDATED EDISON INC	26,947	72.480	1,953,118.560	

CMS ENERGY CORP	23,184	59.470	1,378,752.480	
COOPER COS INC	3,984	289.400	1,152,969.600	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	34.660	572,340.580	
CORNING INC	65,417	26.670	1,744,671.390	
SEALED AIR CORP	13,870	33.830	469,222.100	
HEICO CORP-CL A	7,278	76.950	560,042.100	
CUMMINS INC	12,808	173.800	2,226,030.400	
DR HORTON INC	29,104	58.660	1,707,240.640	
DANAHER CORP	52,365	183.670	9,617,879.550	
MOODY'S CORP	14,130	292.920	4,138,959.600	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,276	55.780	2,525,495.280	
TARGET CORP	41,699	118.860	4,956,343.140	
DEERE & CO	24,765	159.090	3,939,863.850	
MORGAN STANLEY	100,308	49.800	4,995,338.400	
REPUBLIC SERVICES INC	18,180	81.780	1,486,760.400	
COSTAR GROUP INC	3,300	722.030	2,382,699.000	
THE WALT DISNEY CO	150,803	119.340	17,996,830.020	
DOLLAR TREE INC	20,040	91.870	1,841,074.800	
DOVER CORP	12,509	95.150	1,190,231.350	
OMNICOM GROUP	17,365	53.820	934,584.300	
DTE ENERGY CO	16,264	107.510	1,748,542.640	
DUKE ENERGY CORP	61,517	81.320	5,002,562.440	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,790	72.090	849,941.100	
EBAY INC	66,855	59.270	3,962,495.850	
BANK OF AMERICA CORP	655,488	24.020	15,744,821.760	
CITIGROUP INC	176,218	52.650	9,277,877.700	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,121	70.190	850,772.990	
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,757	51.440	1,067,740.080	
EATON CORP PLC	33,708	86.440	2,913,719.520	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,667	100.970	2,288,686.990	
DISH NETWORK CORP	23,723	31.870	756,052.010	
ECOLAB INC	21,194	200.660	4,252,788.040	
PERKINELMER INC	9,621	101.470	976,242.870	
ELECTRONIC ARTS INC	23,965	140.810	3,374,511.650	
SALESFORCE.COM INC	70,369	198.880	13,994,986.720	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	193.830	434,760.690	
EMERSON ELECTRIC CO	51,871	59.770	3,100,329.670	
ATMOS ENERGY CORP	9,937	99.090	984,657.330	
ENTERGY CORP	16,319	98.150	1,601,709.850	
EOG RESOURCES INC	48,085	45.400	2,183,059.000	
EQUIFAX INC	10,344	163.110	1,687,209.840	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,601	189.690	3,528,423.690	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,440	77.580	1,120,255.200	
EXXON MOBIL CORP	354,360	42.650	15,113,454.000	
FMC CORP	10,209	100.190	1,022,839.710	
NEXTERA ENERGY INC	40,861	259.600	10,607,515.600	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,373	350.980	1,183,855.540	

FAIR ISAAC CORP	2,496	412.170	1,028,776.320	
ASSURANT INC	4,594	100.370	461,099.780	
FASTENAL CO	49,297	43.030	2,121,249.910	
FIFTH THIRD BANCORP	58,016	18.390	1,066,914.240	
M&T BANK CORP	11,464	100.370	1,150,641.680	
FISERV INC	47,607	95.980	4,569,319.860	
FLIR SYSTEMS INC	12,717	40.295	512,431.510	
FORD MOTOR CO	331,963	6.100	2,024,974.300	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	21.100	500,344.300	
FREEPORT-MCMORAN INC	114,993	12.970	1,491,459.210	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,924	99.140	1,578,705.360	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	41.980	771,844.280	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,788	141.970	2,951,272.360	
GENERAL MILLS INC	51,027	63.550	3,242,765.850	
GENUINE PARTS CO	11,605	85.580	993,155.900	
GILEAD SCIENCES INC	105,713	76.320	8,068,016.160	
GARTNER INC	7,522	118.940	894,666.680	
MCKESSON CORP	13,720	143.020	1,962,234.400	
NVIDIA CORP	51,124	419.170	21,429,647.080	
GENERAL ELECTRIC CO	718,001	6.690	4,803,426.690	
WW GRAINGER INC	3,745	311.020	1,164,769.900	
HALLIBURTON CO	69,816	12.060	841,980.960	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,591	71.650	2,335,145.150	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,460	205.560	5,644,677.600	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,195	162.510	2,956,869.450	
HASBRO INC	11,383	74.180	844,390.940	
HENRY SCHEIN INC	11,516	57.160	658,254.560	
HEICO CORP	3,623	94.840	343,605.320	
HERSHEY FOODS CORP	12,250	127.750	1,564,937.500	
HP INC	117,832	16.990	2,001,965.680	
F5 NETWORKS INC	4,874	142.520	694,642.480	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	67.340	705,184.480	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	22.620	631,980.180	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	27.560	326,723.800	
HOLOGIC INC	23,457	57.695	1,353,351.610	
HOME DEPOT INC	91,083	250.110	22,780,769.130	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,356	126.060	1,809,717.360	
HORMEL FOODS CORP	23,263	48.200	1,121,276.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	45,978	19.270	885,996.060	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	238.730	695,420.490	
HUMANA INC	10,903	381.580	4,160,366.740	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,392	127.640	943,514.880	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	96,195	8.510	818,619.450	
BIOGEN INC	14,850	278.880	4,141,368.000	
IDEX CORP	6,154	156.940	965,808.760	

ILLINOIS TOOL WORKS	26,224	174.060	4,564,549.440	
INTUIT INC	21,446	307.550	6,595,717.300	
IDEXX LABORATORIES INC	6,933	338.250	2,345,087.250	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	62.090	680,506.400	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,760	91.640	1,810,806.400	
INTEL CORP	358,015	59.530	21,312,632.950	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,206	125.250	902,551.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,282	34.540	1,011,400.280	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,382	16.970	498,612.540	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,705	78.570	919,661.850	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,050	181.530	1,098,256.500	
INCYTE CORP	15,616	104.760	1,635,932.160	
JOHNSON & JOHNSON	219,890	142.370	31,305,739.300	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,620	37.410	1,108,084.200	
KLA CORPORATION	12,667	202.260	2,562,027.420	
KELLOGG CO	21,289	67.190	1,430,407.910	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	34.110	394,311.600	
KEYCORP	84,596	11.550	977,083.800	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,052	143.240	4,018,168.480	
BLACKROCK INC/NEW YORK	12,706	554.080	7,040,140.480	
KROGER CO	66,283	33.440	2,216,503.520	
LAM RESEARCH CORP	12,194	339.980	4,145,716.120	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,160	296.390	936,592.400	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,197	98.890	711,711.330	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,894	114.260	1,473,268.440	
LENNAR CORP	23,510	65.260	1,534,262.600	
ELI LILLY & CO	71,162	163.360	11,625,024.320	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	34.780	533,664.320	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	58,801	115.070	6,766,231.070	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,430	89.420	2,273,950.600	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,236	349.250	7,416,673.000	
LOEWS CORP	21,759	34.500	750,685.500	
LOWE'S COS INC	63,224	137.430	8,688,874.320	
DOMINION ENERGY INC	70,451	73.580	5,183,784.580	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	16.200	624,882.600	
MCCORMICK & CO INC	9,912	185.910	1,842,739.920	
MCDONALD'S CORPORATION	61,981	184.880	11,459,047.280	
S&P GLOBAL INC	20,062	351.810	7,058,012.220	
EVEREST RE GROUP LTD	3,795	206.790	784,768.050	

MARKEL CORPORATION	1,210	913.920	1,105,843.200	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	52,023	67.820	3,528,199.860	
MARSH & MCLENNAN COS	41,917	109.460	4,588,234.820	
MASCO CORP	25,107	49.800	1,250,328.600	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,480	210.150	1,151,622.000	
METLIFE INC	63,036	36.940	2,328,549.840	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,441	64.090	1,374,153.690	
MEDTRONIC PLC	112,084	90.810	10,178,348.040	
ACTIVISION BLIZZARD INC	63,057	81.270	5,124,642.390	
CVS HEALTH CORP	109,168	62.650	6,839,375.200	
MERCK & CO. INC.	211,914	76.730	16,260,161.220	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	20.490	669,736.140	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,070	172.680	1,393,527.600	
MICROSOFT CORP	602,715	213.670	128,782,114.050	
MICRON TECH INC	91,243	50.700	4,626,020.100	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,442	106.610	2,179,321.620	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	54,337	38.305	2,081,378.780	
3M CO	48,186	152.850	7,365,230.100	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	70.470	350,658.720	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,413	128.420	1,850,917.460	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,737	143.740	1,112,116.380	
MYLAN NV	44,496	16.100	716,385.600	
ILLUMINA INC	12,073	370.250	4,470,028.250	
XCEL ENERGY INC	43,154	63.770	2,751,930.580	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,630	129.690	859,844.700	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	39,996	11.230	449,155.080	
NETAPP INC	17,963	42.940	771,331.220	
NEWELL BRANDS INC	33,317	15.805	526,575.180	
NEWMONT CORP	66,868	61.880	4,137,791.840	
NVR INC	316	3,270.710	1,033,544.360	
NIKE INC-CL B	103,832	97.990	10,174,497.680	
NORDSON CORP	4,779	186.380	890,710.020	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,378	170.850	3,652,431.300	
EVERSOURCE ENERGY	28,125	85.440	2,403,000.000	
NISOURCE INC	31,427	23.570	740,734.390	
NORTHERN TRUST CORP	15,687	80.170	1,257,626.790	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,038	292.000	3,807,096.000	
WELLS FARGO & CO	325,752	25.470	8,296,903.440	
NUCOR CORP	23,952	40.450	968,858.400	
CHENIERE ENERGY INC	19,190	48.590	932,442.100	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,703	60.800	2,292,342.400	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,666	16.710	1,281,088.860	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,813	176.880	1,381,963.440	
OGE ENERGY CORP	16,028	30.960	496,226.880	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,222	420.760	2,617,968.720	
ORACLE CORP	189,155	57.390	10,855,605.450	
PACCAR INC	29,586	75.240	2,226,050.640	
PTC INC	10,059	82.890	833,790.510	
EXELON CORP	81,102	37.390	3,032,403.780	
PARKER HANNIFIN CORP	10,985	175.400	1,926,769.000	
PAYCHEX INC	26,101	73.300	1,913,203.300	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,181	273.290	1,689,205.490	
PPL CORPORATION	65,272	25.250	1,648,118.000	
PEPSICO INC	116,194	134.460	15,623,445.240	
PENTAIR PLC	12,511	38.450	481,047.950	
PFIZER INC	462,143	33.830	15,634,297.690	
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,952	43.280	820,242.560	
CONOCOPHILLIPS	90,875	39.690	3,606,828.750	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,597	92.440	1,349,346.680	
ALTRIA GROUP INC	153,682	40.270	6,188,774.140	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,288	101.600	3,686,860.800	
BROWN & BROWN INC	21,068	41.420	872,636.560	
GARMIN LTD	12,490	97.090	1,212,654.100	
PPG INDUSTRIES INC	19,900	107.040	2,130,096.000	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	161.620	421,504.960	
COSTCO WHOLESALE CORP	36,889	326.230	12,034,298.470	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,790	127.270	2,518,673.300	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	116.820	1,271,352.060	
PROCTER & GAMBLE CO	205,989	123.890	25,519,977.210	
PROGRESSIVE CORP	48,963	80.760	3,954,251.880	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	41,882	50.590	2,118,810.380	
PULTE GROUP INC	21,209	35.010	742,527.090	
GLOBAL PAYMENTS INC	25,029	164.540	4,118,271.660	
QUALCOMM INC	95,659	92.510	8,849,414.090	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	68.940	740,691.360	
EXACT SCIENCES CORP	11,306	92.080	1,041,056.480	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,052	174.290	706,223.080	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,462	620.860	5,253,717.320	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	70.310	354,503.020	

RESMED INC	11,940	192.090	2,293,554.600	
US BANCORP	115,008	36.440	4,190,891.520	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,232	174.350	1,783,949.200	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	36,298	28.230	1,024,692.540	
ROSS STORES INC	30,427	86.790	2,640,759.330	
ROLLINS INC	12,378	44.900	555,772.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,929	391.930	3,499,542.970	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,434	210.900	1,989,630.600	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	51.770	728,662.750	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	75.710	833,112.840	
ACCENTURE PLC-CL A	53,021	220.260	11,678,405.460	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	120,222	51.440	6,184,219.680	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,859	202.330	2,197,101.470	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	20,802	113.840	2,368,099.680	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	51,577	136.880	7,059,859.760	
BOOKING HOLDINGS INC	3,447	1,707.400	5,885,407.800	
SCHLUMBERGER LTD	116,108	17.790	2,065,561.320	
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,786	34.800	3,333,352.800	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,910	119.430	2,019,561.300	
BUNGE LTD	10,622	39.890	423,711.580	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	55.220	588,258.660	
ANTHEM INC	20,878	255.000	5,323,890.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,641	97.050	1,226,809.050	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	41.890	928,910.750	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,940	583.800	4,051,572.000	
CENTENE CORP	48,199	62.840	3,028,825.160	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	212.000	857,328.000	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	48.270	547,912.770	
SNAP-ON INC	5,301	131.900	699,201.900	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,741	60.540	1,982,140.140	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	134.450	712,181.650	
EDISON INTERNATIONAL	30,591	55.330	1,692,600.030	
SOUTHERN CO	88,708	53.230	4,721,926.840	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,139	35.200	3,876,892.800	
SOUTHWEST AIRLINES	11,791	33.220	391,697.020	
AT&T INC	600,323	30.130	18,087,731.990	
CHEVRON CORP	157,039	85.230	13,384,433.970	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,100	139.920	1,832,952.000	
STATE STREET CORP	29,847	64.120	1,913,789.640	
STARBUCKS CORP	97,227	74.290	7,222,993.830	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	25.800	452,712.600	
STRYKER CORP	28,324	177.890	5,038,556.360	

NETFLIX INC	36,626	548.730	20,097,784.980	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	20.300	993,786.500	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	43.860	429,520.980	
SYNOPSYS INC	12,867	198.010	2,547,794.670	
SYSCO CORP	38,931	52.310	2,036,480.610	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,748	575.870	5,613,580.760	
TELEFLEX INC	3,899	354.780	1,383,287.220	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	11.760	1,038,666.720	
TERADYNE INC	14,447	87.380	1,262,378.860	
TEXAS INSTRUMENTS INC	78,455	130.530	10,240,731.150	
TEXTRON INC	20,009	31.060	621,479.540	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,311	382.570	12,743,789.270	
TIFFANY & CO	8,733	121.300	1,059,312.900	
GLOBE LIFE INC	9,042	72.320	653,917.440	
DAVITA INC	7,993	81.190	648,951.670	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	138.420	1,325,094.660	
TRIMBLE INC	20,073	42.540	853,905.420	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,294	359.730	1,184,950.620	
TYSON FOODS INC	25,079	58.520	1,467,623.080	
UGI CORP	19,841	30.820	611,499.620	
UNION PACIFIC CORP	57,764	166.390	9,611,351.960	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	126,930	59.640	7,570,105.200	
UNITEDHEALTH GROUP INC	79,271	291.230	23,086,093.330	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	89.760	552,293.280	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	118.920	859,315.920	
VF CORP	26,912	60.740	1,634,634.880	
VIACOMCBS INC	45,361	22.930	1,040,127.730	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,808	294.450	6,421,365.600	
VULCAN MATERIALS CO	11,057	118.790	1,313,461.030	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,594	40.120	2,511,271.280	
WALMART INC	118,360	130.680	15,467,284.800	
WASTE MANAGEMENT INC	34,870	103.820	3,620,203.400	
WATERS CORP	5,211	188.750	983,576.250	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,024	232.230	1,398,953.520	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	105.180	965,131.680	
VAIL RESORTS INC	3,109	182.260	566,646.340	
WESTERN DIGITAL CORP	25,867	42.310	1,094,432.770	
WABTEC CORP	15,540	57.630	895,570.200	
WHIRLPOOL CORP	4,673	135.640	633,845.720	

SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,935	131.220	1,828,550.700	
WYNN RESORTS LTD	8,639	74.130	640,409.070	
NASDAQ INC	9,020	122.880	1,108,377.600	
CME GROUP INC	29,453	164.590	4,847,669.270	
WILLIAMS COS INC	99,729	18.550	1,849,972.950	
LKQ CORP	23,691	25.655	607,792.600	
ALLIANT ENERGY CORP	19,849	49.040	973,394.960	
WEC ENERGY GROUP INC	26,725	88.050	2,353,136.250	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	37.640	821,304.800	
CARMAX INC	14,208	88.190	1,253,003.520	
XILINX INC	20,663	99.140	2,048,529.820	
TJX COMPANIES INC	99,863	51.070	5,100,003.410	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,227	260.670	1,101,852.090	
ZIONS BANCORP NA	13,142	32.210	423,303.820	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	4.850	132,890.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.040	439,148.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,800	41.700	742,260.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	20.760	354,996.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,381	162.250	1,522,067.250	
SIGNATURE BANK	4,171	104.100	434,201.100	
CBRE GROUP INC	26,811	44.200	1,185,046.200	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	22.900	291,562.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	10.290	786,979.200	
DOMINO'S PIZZA INC	3,212	398.310	1,279,371.720	
T-MOBILE US INC	45,039	107.050	4,821,424.950	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,755	45.720	1,268,958.600	
MOSAIC CO/THE	28,249	12.300	347,462.700	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,218	537.230	1,728,806.140	
CELANESE CORP	10,139	86.450	876,516.550	
DEXCOM INC	7,700	439.640	3,385,228.000	
DISCOVERY INC-A	10,423	20.230	210,857.290	
EXPEDIA GROUP INC	12,120	83.540	1,012,504.800	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	28.120	519,517.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,651	148.580	1,582,525.580	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	22.560	767,558.880	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	45,683	92.550	4,227,961.650	
LIVE NATION	13,804	46.440	641,057.760	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,246	1,118.040	2,511,117.840	
TRANSDIGM GROUP INC	4,356	420.880	1,833,353.280	

MASTERCARD INC	74,706	295.680	22,089,070.080	
WESTERN UNION CO	35,367	21.330	754,378.110	
OWENS CORNING	9,690	55.310	535,953.900	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,057	87.910	972,020.870	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	28.710	252,848.970	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	15.610	270,833.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	126.060	1,156,726.560	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	40,369	11.130	449,306.970	
DELTA AIR LINES INC	11,158	27.090	302,270.220	
INSULET CORP	4,854	207.820	1,008,758.280	
DISCOVER FINANCIAL	24,889	48.380	1,204,129.820	
TE CONNECTIVITY LTD	27,638	78.770	2,177,045.260	
MASIMO CORP	4,422	231.130	1,022,056.860	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,401	49.240	807,585.240	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,415	314.390	3,274,371.850	
VMWARE INC	6,532	146.090	954,259.880	
MERCADOLIBRE INC	3,777	1,035.830	3,912,329.910	
ULTA BEAUTY INC	4,759	195.990	932,716.410	
INVESCO LTD	33,443	10.530	352,154.790	
MSCI INC	7,151	370.950	2,652,663.450	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,047	72.960	9,488,229.120	
VISA INC	142,391	192.550	27,417,387.050	
KEURIG DR PEPPER INC	30,182	29.200	881,314.400	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,441	133.390	2,059,674.990	
DISCOVERY INC-C	30,421	18.075	549,859.570	
MARATHON PETROLEUM CORP	53,851	36.200	1,949,406.200	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,110	64.830	785,091.300	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	170,954	14.240	2,434,384.960	
XYLEM INC	15,151	66.510	1,007,693.010	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,328	65.040	1,517,253.120	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	167.040	581,967.360	
SPLUNK INC	13,107	211.320	2,769,771.240	
EPAM SYSTEMS INC	4,738	261.140	1,237,281.320	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	50.090	742,033.260	
HCA HEALTHCARE INC	22,066	96.720	2,134,223.520	
VERISK ANALYTICS INC	12,587	174.170	2,192,277.790	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	106.600	455,501.800	

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,037	253.010	1,780,431.370	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,975	105.480	1,474,083.000	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,860	117.100	2,676,906.000	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	75.310	878,641.770	
LEAR CORP	4,681	104.680	490,007.080	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	91.550	789,344.100	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	19,738	56.450	1,114,210.100	
DOLLAR GENERAL CORP	20,951	188.240	3,943,816.240	
FORTINET INC	12,393	145.800	1,806,899.400	
TESLA INC	12,321	1,544.650	19,031,632.650	
GENERAL MOTORS CO	109,268	24.390	2,665,046.520	
XPO LOGISTICS INC	7,614	78.450	597,318.300	
ALLY FINANCIAL INC	34,101	20.120	686,112.120	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	46.460	477,283.580	
APTIV PLC	21,364	76.280	1,629,645.920	
PHILLIPS 66	36,678	61.060	2,239,558.680	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,589	117.150	889,051.350	
FACEBOOK INC	200,842	245.070	49,220,348.940	
IQVIA HOLDINGS INC	16,329	142.680	2,329,821.720	
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,424	38.930	444,736.320	
SERVICENOW INC	15,570	422.910	6,584,708.700	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,043	248.960	2,002,385.280	
WORKDAY INC	14,087	195.880	2,759,361.560	
ABBVIE INC	147,512	96.830	14,283,586.960	
ZOETIS INC	39,197	137.100	5,373,908.700	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	11.960	361,945.480	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	32.870	462,645.250	
CDW CORP	11,478	113.840	1,306,655.520	
HOWMET AEROSPACE INC	30,749	15.330	471,382.170	
TWILIO INC	10,057	240.580	2,419,513.060	
COUPA SOFTWARE INC	5,638	308.280	1,738,082.640	
SNAP INC	74,322	25.530	1,897,440.660	
TRADE DESK INC A	3,461	461.980	1,598,912.780	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,890	34.300	647,927.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	33.810	281,434.440	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	33.700	478,708.500	
OKTA INC	9,637	218.730	2,107,901.010	
BLACK KNIGHT INC	12,793	71.150	910,221.950	
BAKER HUGHES CO	51,005	15.050	767,625.250	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	63.010	830,534.810	
ALTICE USA INC-A	28,646	23.520	673,753.920	
BROADCOM INC	33,443	319.440	10,683,031.920	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,250	284.500	1,778,125.000	
MONGODB INC	3,594	228.340	820,653.960	

BURLINGTON STORES INC	5,912	178.480	1,055,173.760	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	22.030	789,202.720	
VEEVA SYSTEMS INC	10,594	254.160	2,692,571.040	
TWITTER INC	63,023	35.400	2,231,014.200	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	36.520	482,575.280	
EVERGY INC	18,388	61.980	1,139,688.240	
ALLEGION PLC	7,469	101.510	758,178.190	
STERIS PLC	7,336	150.510	1,104,141.360	
DOCUSIGN INC	14,332	210.110	3,011,296.520	
WIX.COM LTD	4,000	294.230	1,176,920.000	
DROPBOX INC	17,573	22.110	388,539.030	
KKR & CO INC	42,982	34.890	1,499,641.980	
PERRIGO CO PLC	10,553	55.170	582,209.010	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	9,111	275.870	2,513,451.570	
MODERNA INC	22,964	62.610	1,437,776.040	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,987	75.240	1,729,541.880	
ARAMARK	18,632	21.620	402,823.840	
CIGNA CORP	31,336	175.540	5,500,721.440	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,586	53.430	1,099,909.980	
DOW INC	60,823	40.760	2,479,145.480	
AMCOR PLC	130,000	10.510	1,366,300.000	
PINTEREST INC	31,384	26.560	833,559.040	
FOX CORP-A	31,825	25.320	805,809.000	
FOX CORP-B	13,009	25.390	330,298.510	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	8,760	116.650	1,021,854.000	
AVANTOR INC	36,868	18.210	671,366.280	
DYNATRACE INC	10,850	43.380	470,673.000	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	54.750	386,808.750	
CARRIER GLOBAL CORP	65,428	24.890	1,628,502.920	
OTIS WORLDWIDE CORP	32,714	56.980	1,864,043.720	
UBER TECHNOLOGIES INC	79,861	33.140	2,646,593.540	
CORTEVA INC	63,287	26.620	1,684,699.940	
MATCH GROUP INC	18,335	100.390	1,840,650.650	
SLACK TECHNOLOGIES INC	26,131	33.840	884,273.040	
BLACKSTONE GROUP INC	56,393	53.730	3,029,995.890	
CARLYLE GROUP INC	12,509	28.250	353,379.250	
DATADOG INC	8,925	96.410	860,459.250	
INGERSOLL RAND INC	28,361	28.310	802,899.910	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,923	309.000	1,212,207.000	
T-MOBILE US INC-RTS	35,039	0.216	7,568.420	
AON PLC	19,230	197.560	3,799,078.800	
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	127.490	811,346.360	
ARISTA NETWORKS INC	4,385	216.110	947,642.350	
IHS MARKIT LTD	31,844	75.640	2,408,680.160	
FNF GROUP	21,372	30.610	654,196.920	
CATALENT INC	13,331	78.010	1,039,951.310	

	SYNCHRONY FINANCIAL	45,491	22.560	1,026,276.960	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	36,972	24.180	893,982.960	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	109.000	376,813.000	
	CDK GLOBAL INC	9,969	40.450	403,246.050	
	WAYFAIR INC	5,091	223.760	1,139,162.160	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,555	97.640	1,518,790.200	
	QORVO INC	9,133	112.010	1,022,987.330	
	LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,800	126.020	352,856.000	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	128.660	1,068,778.620	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	22.240	378,480.320	
	GODADDY INC	14,540	72.450	1,053,423.000	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	14.630	383,364.520	
	TRANSUNION	15,196	83.050	1,262,027.800	
	SQUARE INC	28,837	128.050	3,692,577.850	
	DUPONT DE NEMOURS INC	61,980	52.240	3,237,835.200	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	20,048	38.800	777,862.400	
	TELADOC HEALTH INC	5,973	228.980	1,367,697.540	
	WESTROCK CO	22,778	27.750	632,089.500	
	KRAFT HEINZ CO	56,143	32.280	1,812,296.040	
	FORTIVE CORP	25,025	67.260	1,683,181.500	
	WASTE CONNECTIONS INC	22,092	98.400	2,173,852.800	
	ALPHABET INC-CL A	25,343	1,539.010	39,003,130.430	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	105,599	9.260	977,846.740	
	PAYPAL HOLDINGS INC	93,015	178.400	16,593,876.000	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	37,687	19.210	723,967.270	
	ZILLOW GROUP INC-C	10,805	62.250	672,611.250	
	ALPHABET INC-CL C	25,305	1,541.740	39,013,730.700	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	196.030	619,258.770	
	CABLE ONE INC	392	1,770.180	693,910.560	
	LINDE PLC	44,464	225.950	10,046,640.800	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	30.940	366,546.180	
	ROKU INC	7,054	153.050	1,079,614.700	
	AVALARA INC	6,312	136.540	861,840.480	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,394	537.920	6,666,980.480	
	VISTRA CORP	38,032	18.870	717,663.840	
アメリカ・ドル	小計	24,643,229		2,295,702,443.760 (245,272,849,095)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	9.870	313,846.260	
	ASHTAD GROUP	38,255	25.650	981,240.750	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	23.790	433,382.430	

BHP GROUP PLC	181,953	16.648	3,029,153.540	
BARCLAYS PLC	1,420,719	1.177	1,672,186.260	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	5.436	447,290.380	
BT GROUP PLC	723,199	1.100	795,518.900	
BUNZL PLC	28,834	21.970	633,482.980	
AVIVA PLC	318,596	2.828	900,989.480	
CRODA INTERNATIONAL	10,391	53.960	560,698.360	
DIAGEO PLC	196,695	27.615	5,431,732.420	
SCHRODERS PLC	11,354	29.300	332,672.200	
DCC PLC	7,898	68.260	539,117.480	
NATIONAL GRID PLC	287,812	8.710	2,506,842.520	
KINGFISHER PLC	165,680	2.248	372,448.640	
BAE SYSTEMS PLC	269,245	4.745	1,277,567.520	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	192,040	28.780	5,526,911.200	
HALMA PLC	31,901	22.790	727,023.790	
NEXT PLC	12,524	47.170	590,757.080	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,235	14.000	1,095,290.000	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	21.140	317,459.380	
ANGLO AMERICAN PLC	104,644	19.250	2,014,397.000	
COMPASS GROUP PLC	152,134	11.150	1,696,294.100	
HSBC HOLDINGS PLC	1,696,711	3.778	6,410,174.150	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	517,170	2.204	1,139,842.680	
UNILEVER PLC	98,048	41.930	4,111,152.640	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	224,069	1.828	409,598.130	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.670	472,402.290	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	4.199	339,547.930	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	19.450	606,178.700	
PEARSON PLC	65,009	5.588	363,270.290	
PERSIMMON PLC	28,006	26.350	737,958.100	
PRUDENTIAL PLC	216,909	12.435	2,697,263.410	
RIO TINTO PLC	91,243	46.160	4,211,776.880	
VODAFONE GROUP PLC	2,229,795	1.234	2,751,567.030	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	59,436	76.140	4,525,457.040	
RELX PLC	160,493	18.100	2,904,923.300	
RENTOKIL INITIAL PLC	146,366	5.230	765,494.180	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	168,412	2.667	449,154.800	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	423,054	1.215	514,010.610	
ST JAMES'S PLACE PLC	38,985	9.570	373,086.450	
SSE PLC	81,857	13.210	1,081,330.970	
BP PLC	1,716,351	2.908	4,991,148.700	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	6.578	573,016.150	

SMITHS GROUP PLC	31,720	14.305	453,754.600	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	100.400	554,007.200	
STANDARD CHARTERED PLC	220,443	4.342	957,163.500	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,981,916	0.304	1,818,502.460	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.450	365,816.150	
TESCO PLC	798,198	2.148	1,714,529.300	
3I GROUP PLC	76,643	8.252	632,458.030	
SMITH & NEPHEW PLC	69,875	15.170	1,060,003.750	
GLAXOSMITHKLINE PLC	420,388	15.750	6,621,111.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,594	83.520	2,137,610.880	
WPP PLC	107,148	5.856	627,458.680	
ASTRAZENECA PLC	109,677	85.050	9,328,028.850	
WHITBREAD PLC	18,594	22.680	421,711.920	
INTERTEK GROUP PLC	14,390	53.360	767,850.400	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	15.500	491,133.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,397	37.740	581,082.780	
ITV PLC	254,308	0.673	171,149.280	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	1.937	265,785.450	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	22.860	363,313.980	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,271	44.310	499,418.010	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	339,119	12.464	4,226,779.210	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	311,410	11.888	3,702,042.080	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,010	21.050	273,860.500	
AVEVA GROUP PLC	5,704	40.110	228,787.440	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.632	543,015.810	
EXPERIAN PLC	74,660	27.790	2,074,801.400	
MONDI PLC	39,767	14.435	574,036.640	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	15.555	435,711.100	
OCADO GROUP PLC	39,210	20.020	784,984.200	
INFORMA PLC	135,291	4.403	595,686.270	
GLENCORE PLC	880,918	1.753	1,544,249.250	
GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.632	428,302.570	
EVRAZ PLC	48,765	2.991	145,856.110	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.824	318,247.850	
COCA-COLA HBC AG	15,208	20.310	308,874.480	
FERGUSON PLC	19,440	66.020	1,283,428.800	
M&G PLC	204,940	1.735	355,570.900	
JD SPORTS FASHION PLC	32,086	6.480	207,917.280	
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.136	392,123.320	
MELROSE INDUSTRIES PLC	364,735	1.182	431,116.770	
イギリス・ボンド 小計	24,190,374		121,311,938.300	

				(16,375,898,551)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	21.050	2,154,656.950	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	17.820	2,329,127.460	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	452.000	795,520.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	11.620	1,186,797.080	
	ICL GROUP LTD	49,411	10.760	531,662.360	
	NICE LTD	4,902	671.300	3,290,712.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	71.490	746,641.560	
	AZRIELI GROUP	2,291	161.000	368,851.000	
イスラエル・シュケル 小計		404,004		11,403,969.010 (352,268,603)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,975	62.980	1,006,105.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	232,231	18.300	4,249,827.300	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	307,198	17.660	5,425,116.680	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	141,880	14.850	2,106,918.000	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.500	1,275,431.500	
	AMP LTD	302,414	1.715	518,640.010	
	ASX LTD	15,573	84.800	1,320,590.400	
	BHP GROUP LTD	246,997	36.190	8,938,821.430	
	AMPOL LTD	20,946	28.100	588,582.600	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	13.270	504,790.800	
	CSL LIMITED	38,037	282.370	10,740,507.690	
	REA GROUP LTD	4,119	104.750	431,465.250	
	TRANSURBAN GROUP	223,753	13.570	3,036,328.210	
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,458	8.520	446,942.160	
	COCHLEAR LTD	5,533	190.470	1,053,870.510	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,860	5.730	761,287.800	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	148,936	70.630	10,519,349.680	
	RIO TINTO LIMITED	30,466	97.990	2,985,363.340	
	APA GROUP	94,106	10.850	1,021,050.100	
	ARISTOCRAT LEISU	45,323	24.180	1,095,910.140	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	177,176	5.540	981,555.040	
	TPG TELECOM LTD	28,719	8.370	240,378.030	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	26.380	894,967.880	
	ORICA LTD	40,893	16.150	660,421.950	
CIMIC GROUP LTD	8,709	22.310	194,297.790		
LEND LEASE CORP LTD	62,116	11.450	711,228.200		
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	10.780	398,223.980		
SYDNEY AIRPORT	85,130	5.300	451,189.000		
MACQUARIE GROUP LTD	28,763	119.800	3,445,807.400		
SUNCORP GROUP LTD	110,775	8.780	972,604.500		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	264,896	17.860	4,731,042.560	
	NEWCREST MINING LTD	70,138	33.220	2,329,984.360	
	OIL SEARCH LTD	197,895	3.000	593,685.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	3.510	218,609.820	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,359	9.260	1,086,744.340	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	63,404	14.760	935,843.040	
	SANTOS LTD	132,862	5.190	689,553.780	
	SONIC HEALTHCARE	40,667	30.900	1,256,610.300	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	15,775	19.820	312,660.500	
	TABCORP HOLDINGS LTD	158,601	3.240	513,867.240	
	WESFARMERS LTD	92,712	45.490	4,217,468.880	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	80,277	21.140	1,697,055.780	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	106,691	38.510	4,108,670.410	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	61.250	612,193.750	
	SEEK LTD	25,899	21.420	554,756.580	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.680	277,310.880	
	AGL ENERGY LTD	49,076	16.890	828,893.640	
	BRAMBLES LTD	127,166	11.120	1,414,085.920	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	9.030	296,734.830	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	6.130	864,109.320	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	4.730	710,209.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	10.520	606,656.840	
	AFTERPAY LTD	18,322	72.310	1,324,863.820	
	TUAS LTD	14,359	0.800	11,487.200	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	2.930	606,246.300	
	SOUTH32 LTD(AUD)	472,144	2.040	963,173.760	
	COLES GROUP LTD	109,456	17.720	1,939,560.320	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	20.340	162,720.000	
	オーストラリア・ドル 小計	6,065,996		100,842,371.540 (7,485,529,239)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,234	88.400	1,700,285.600	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	73,988	45.750	3,384,951.000	
	BARRICK GOLD CORP	145,340	36.820	5,351,418.800	
	ATCO LTD	7,193	40.550	291,676.150	
	BANK OF MONTREAL	53,051	72.820	3,863,173.820	
	BANK OF NOVA SCOTIA	100,112	55.540	5,560,220.480	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,047	61.250	1,779,128.750	
	BCE INC	11,673	55.150	643,765.950	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	109,906	44.660	4,908,401.960	
	BAUSCH HEALTH COS INC	27,978	23.380	654,125.640	
	SAPUTO INC	18,601	32.050	596,162.050	

BLACKBERRY LTD	39,652	6.430	254,962.360	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	46,369	17.620	817,021.780	
CGI INC	21,239	86.740	1,842,270.860	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	44.380	503,269.200	
CAE INC	19,684	20.880	411,001.920	
CAMECO CORP	32,627	14.740	480,921.980	
ROGERS COMM-CL B	30,750	53.590	1,647,892.500	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,484	91.620	3,525,904.080	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,962	22.910	2,313,039.420	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	117.010	568,902.620	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	33.380	304,392.220	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,452	121.880	7,367,889.760	
YAMANA GOLD INC	84,317	7.490	631,534.330	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	20.410	324,743.510	
OPEN TEXT CORP	21,795	58.040	1,264,981.800	
EMPIRE CO LTD	15,093	32.480	490,220.640	
KINROSS GOLD CORP	99,741	10.340	1,031,321.940	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	10,319	56.260	580,546.940	
FORTIS INC	41,367	51.880	2,146,119.960	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	50,077	13.450	673,535.650	
TELUS CORP	31,890	22.690	723,584.100	
GREAT WEST LIFECO INC	19,881	23.900	475,155.900	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	20.900	450,227.800	
ENBRIDGE INC	170,809	40.150	6,857,981.350	
IGM FINANCIAL INC	10,692	32.170	343,961.640	
MANULIFE FINANCIAL CORP	158,209	18.340	2,901,553.060	
LOBLAW CO LTD	15,136	67.430	1,020,620.480	
MAGNA INTERNATIONAL INC	24,355	62.330	1,518,047.150	
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,404	49.850	2,412,939.400	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	406.480	842,226.560	
METRO INC	19,949	56.640	1,129,911.360	
EMERA INC	19,138	53.750	1,028,667.500	
ONEX CORP	6,646	58.260	387,195.960	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	44.040	826,454.640	
POWER CORP OF CANADA	46,551	23.970	1,115,827.470	
QUEBECOR INC-B	17,237	28.770	495,908.490	
ROYAL BANK OF CANADA	117,632	93.080	10,949,186.560	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,307	351.080	3,969,661.560	
SHAW COMM INC-B	36,251	22.460	814,197.460	
SUNCOR ENERGY INC	125,040	21.950	2,744,628.000	
LUNDIN MINING CORP	43,480	8.180	355,666.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	14.970	614,009.520	

	THOMSON REUTERS CORP	16,252	91.900	1,493,558.800	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	152,437	59.920	9,134,025.040	
	TC ENERGY CORP	78,207	56.830	4,444,503.810	
	WESTON (GEORGE) LTD	6,184	101.300	626,439.200	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,464	131.750	1,642,132.000	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,085	63.410	2,288,149.850	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,707	1,611.990	2,751,666.930	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,080	194.630	3,129,650.400	
	B2GOLD CORP	94,232	8.070	760,452.240	
	CI FINANCIAL CORP	27,105	17.940	486,263.700	
	KEYERA CORP	16,668	20.150	335,860.200	
	PARKLAND CORP	10,583	32.920	348,392.360	
	ALTAGAS LTD	23,944	15.960	382,146.240	
	PEMBINA PIPELINE CORP	43,740	31.990	1,399,242.600	
	DOLLARAMA INC	23,536	46.600	1,096,777.600	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	5.990	483,518.790	
	TMX GROUP LTD	5,058	133.510	675,293.580	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,762	62.370	1,482,035.940	
	INTER PIPELINE LTD	27,946	11.950	333,954.700	
	NUTRIEN LTD	48,340	43.160	2,086,354.400	
	CRONOS GROUP INC	16,000	8.600	137,600.000	
	WSP GLOBAL INC	8,400	81.460	684,264.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	44.020	356,738.080	
	AIR CANADA	10,722	16.170	173,374.740	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	22,446	74.810	1,679,185.260	
	SHOPIFY INC	8,761	1,402.410	12,286,514.010	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	23.660	440,880.440	
	HYDRO ONE LTD	27,340	26.170	715,487.800	
	カナダ・ドル 小計	3,221,744		149,745,858.740 (11,777,511,790)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.350	418,750.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	144,100	21.650	3,119,765.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	8.710	317,044.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	20.480	121,733.120	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	8.350	575,315.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	2.910	595,138.650	
	GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.770	328,636.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	6.060	817,494.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	271,653	9.250	2,512,790.250	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,822	2.510	1,698,823.220	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	195,750	3.810	745,807.500	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	104,000	21.000	2,184,000.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.890	279,045.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.760	351,960.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	4.260	606,198.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.945	178,416.000	
	シンガポール・ドル 小計	2,787,384		14,850,915.740 (1,141,886,911)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	210,342	9.860	2,073,972.120	
	LOGITECH INTL-REG	14,259	63.100	899,742.900	
	NESTLE SA-REGISTERED	248,407	107.160	26,619,294.120	
	CIE FINANC RICHEMONT	43,393	62.640	2,718,137.520	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	58,663	332.050	19,479,049.150	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	237.900	824,799.300	
	SIKA INHABER	11,874	190.600	2,263,184.400	
	SGS SA-REG	478	2,352.000	1,124,256.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	179,363	82.000	14,707,766.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,199	142.900	600,037.100	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	1,878.000	497,670.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	17.845	356,525.250	
	SWISSCOM AG-REG	2,192	492.200	1,078,902.400	
	ABB LTD	151,150	22.960	3,470,404.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	44.510	576,137.440	
	GEBERIT AG	3,187	484.300	1,543,464.100	
	LONZA GROUP AG-REG	6,137	538.400	3,304,160.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	7,660.000	727,700.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	82,300.000	740,700.000	
	GIVAUDAN-REG	768	3,622.000	2,781,696.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,200	340.800	4,157,760.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	44,432	42.490	1,887,915.680	
	TEMENOS GROUP	5,723	157.450	901,086.350	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	199.700	938,190.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,518	157.200	710,229.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	849.800	674,741.200	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,829	191.700	542,319.300	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	37.180	170,730.560	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	238.200	396,126.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,830	351.200	993,896.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	91.100	227,750.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	142.250	492,896.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	764.000	483,612.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	87.850	526,221.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,515	881.800	1,335,927.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	40.710	726,632.790	
	SWISS RE LTD	24,292	74.480	1,809,268.160	

	ALCON INC	41,377	52.980	2,192,153.460	
	UBS GROUP AG	307,158	11.135	3,420,204.330	
スイス・フラン	小計	1,460,229		108,975,259.980 (12,381,769,039)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,126	407.800	21,664,782.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,341	359.000	11,969,419.000	
	ERICSSON LM-B SHS	253,072	86.460	21,880,605.120	
	LUNDBERGS B	7,382	421.400	3,110,774.800	
	SKF AB-B SHS	28,812	181.800	5,238,021.600	
	SANDVIK AB	98,784	179.300	17,711,971.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	86.040	11,256,355.080	
	SKANSKA AB-B SHS	25,018	191.550	4,792,197.900	
	SWEDBANK AB	71,958	133.380	9,597,758.040	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	111.200	5,887,484.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,411	90.160	11,397,215.760	
	VOLVO AB-B SHS	119,911	153.300	18,382,356.300	
	SWEDISH MATCH AB	14,752	648.000	9,559,296.000	
	TELE2 AB-B SHS	44,518	121.400	5,404,485.200	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	217.500	2,480,152.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	173.600	3,331,557.600	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	123.550	2,977,307.900	
	INVESTOR AB-B SHS	38,580	506.200	19,529,196.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	62,087	137.650	8,546,275.550	
	ASSA ABLOY AB-B	80,174	196.450	15,750,182.300	
	TELIA CO AB	230,897	34.570	7,982,109.290	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	218.300	3,217,523.700	
	BOLIDEN AB	21,855	231.800	5,065,989.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	204.100	4,764,306.300	
	KINNEVIK AB-B	18,310	263.300	4,821,023.000	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	445.800	4,016,212.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	80.040	2,696,707.680	
	NIBE INDUSTRIER AB	28,087	211.100	5,929,165.700	
	HEXAGON AB	24,298	550.400	13,373,619.200	
	EPIROC AB-A	63,371	117.900	7,471,440.900	
	EPIROC AB-B	30,899	115.800	3,578,104.200	
	ESSITY AB-B	52,640	295.500	15,555,120.000	
	EQT AB	20,934	184.400	3,860,229.600	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	10,916	662.200	7,228,575.200	
	NORDEA BANK ABP	262,037	65.680	17,210,590.160	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	172.300	2,575,023.500	
スウェーデン・クローナ	小計	2,156,362		319,813,134.280 (3,713,030,489)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	8,776	926.600	8,131,841.600	

	A P MOLLER A/S	491	8,182.000	4,017,362.000	
	AP MOLLER MAERSK A	435	7,570.000	3,292,950.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	95.720	4,884,974.480	
	GENMAB A/S	5,646	2,313.000	13,059,198.000	
	NOVOZYMES-B SHS	18,310	384.600	7,042,026.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	148,205	431.850	64,002,329.250	
	GN STORE NORD A/S	11,536	375.500	4,331,768.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,958	742.400	12,589,619.200	
	COLOPLAST-B	9,511	1,053.500	10,019,838.500	
	DSV PANALPINA A S	17,572	835.800	14,686,677.600	
	DEMANT A/S	7,244	185.400	1,343,037.600	
	H LUNDBECK A/S	4,840	242.000	1,171,280.000	
	TRYG A/S	11,107	196.100	2,178,082.700	
	PANDORA A/S	8,251	394.000	3,250,894.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,258	697.600	6,458,380.800	
	AMBU A/S B	14,156	233.500	3,305,426.000	
	ORSTED A/S	15,144	852.200	12,905,716.800	
デンマーク・クローネ 小計		358,474		176,671,402.530 (2,867,376,863)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	6.240	531,928.800	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	13.100	391,611.400	
	A2 MILK CO LTD	55,091	20.530	1,131,018.230	
	FISHER & PAYKEL	50,218	35.300	1,772,695.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.600	734,265.800	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	4.680	288,915.120	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.510	559,970.620	
ニュージーランド・ドル 小計		565,967		5,410,405.370 (380,026,873)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	167.200	5,882,597.600	
	DNB ASA	83,164	129.600	10,778,054.400	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	27.350	2,547,351.650	
	TELENOR ASA	56,638	141.650	8,022,772.700	
	ORKLA ASA	65,283	84.760	5,533,387.080	
	EQUINOR ASA	83,149	137.950	11,470,404.550	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,390	336.400	5,513,596.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	185.400	3,093,028.200	
SCHIBSTED ASA	7,445	225.000	1,675,125.000		
ノルウェー・クローネ 小計		457,074		54,516,317.180 (617,124,710)	
ユーロ	CRH PLC	66,819	32.320	2,159,590.080	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,676	118.650	1,385,357.400	
	KERRY GROUP PLC-A	13,521	107.900	1,458,915.900	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,741	61.500	722,071.500	
	UMICORE	17,654	43.380	765,830.520	

AIR LIQUIDE	39,705	135.000	5,360,175.000	
AIRBUS SE	47,905	65.450	3,135,382.250	
AXA	158,477	18.280	2,896,959.560	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,117	19.555	862,707.930	
ADIDAS AG	16,036	235.600	3,778,081.600	
ASSICURAZIONI GENERALI	87,009	13.495	1,174,186.450	
DASSAULT AVIATION SA	137	827.000	113,299.000	
DANONE	50,891	60.640	3,086,030.240	
SAFRAN SA	28,002	88.920	2,489,937.840	
INTESA SANPAOLO	1,245,487	1.765	2,198,284.550	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,741	58.690	1,628,119.290	
ACCOR SA	17,380	24.130	419,379.400	
BOUYGUES	17,572	31.890	560,371.080	
BNP PARIBAS	94,888	36.680	3,480,491.840	
THALES SA	8,549	71.300	609,543.700	
CAPGEMINI SA	13,801	104.250	1,438,754.250	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	29.550	126,001.200	
INGENICO GROUP	4,498	142.500	640,965.000	
UNICREDIT SPA	173,574	8.520	1,478,850.480	
NATIXIS	70,166	2.368	166,153.080	
KONINKLIJKE DSM NV	14,867	126.650	1,882,905.550	
COMMERZBANK AG	83,118	4.554	378,519.370	
EIFFAGE	6,461	79.360	512,744.960	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,713	44.310	1,538,133.030	
UNITED INTERNET	9,882	39.110	386,485.020	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	37.400	207,420.400	
PUBLICIS GROUPE	20,157	26.810	540,409.170	
FAURECIA	6,117	34.550	211,342.350	
IBERDROLA SA	490,508	10.730	5,263,150.840	
ENI SPA	211,633	8.492	1,797,187.430	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.435	301,244.890	
KBC GROUPE	21,124	52.140	1,101,405.360	
HANNOVER RUECK SE	4,868	153.600	747,724.800	
WARTSILA OYJ	34,935	7.086	247,549.410	
L'OREAL	21,024	288.600	6,067,526.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,268	400.700	9,323,487.600	
GEA GROUP AG	11,838	30.300	358,691.400	
BOLLORE	71,347	2.832	202,054.700	
MEDIOBANCA SPA	62,568	6.760	422,959.680	
MICHELIN(CGDE)-B	13,862	93.360	1,294,156.320	
CONTINENTAL AG	8,640	85.900	742,176.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,177	34.000	2,760,018.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	17.310	274,969.350	
OMV AG	12,817	29.480	377,845.160	
VERBUND AG	4,908	41.120	201,816.960	

PERNOD-RICARD	17,836	141.300	2,520,226.800	
PEUGEOT SA	44,683	14.040	627,349.320	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,649	53.920	682,034.080	
RENAULT SA	14,917	22.415	334,364.550	
REPSOL SA	117,630	7.624	896,811.120	
REMY COINTREAU	1,860	125.200	232,872.000	
MERCK KGAA	11,125	110.150	1,225,418.750	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	44,369	32.060	1,422,470.140	
RWE AG	46,489	32.190	1,496,480.910	
SEB SA	1,551	143.000	221,793.000	
SOCIETE GENERALE-A	68,153	15.130	1,031,154.890	
VINCI S.A.	42,889	80.500	3,452,564.500	
SODEXO	7,075	62.480	442,046.000	
SOFINA	1,382	241.000	333,062.000	
SOLVAY SA	5,563	70.840	394,082.920	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,679	96.860	4,521,327.940	
VIVENDI SA	68,572	23.180	1,589,498.960	
SAP SE	87,295	135.040	11,788,316.800	
TELEFONICA S.A	394,836	3.999	1,578,949.160	
TOTAL SA	207,416	33.320	6,911,101.120	
VALEO	19,653	23.740	466,562.220	
E.ON SE	190,255	10.040	1,910,160.200	
VOEST-ALPINE AG	9,875	19.265	190,241.870	
HENKEL AG & CO KGAA	7,455	73.500	547,942.500	
SIEMENS AG-REG	64,354	108.000	6,950,232.000	
UPM-KYMMENE OYJ	44,829	24.080	1,079,482.320	
ING GROEP NV-CVA	316,722	6.347	2,010,234.530	
PUMA AG	7,534	67.700	510,051.800	
BAYER AG	81,034	63.700	5,161,865.800	
STORA ENSO OYJ-R SHS	54,622	10.570	577,354.540	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,452	83.480	1,289,932.960	
DAIMLER AG	75,045	36.675	2,752,275.370	
BASF SE	75,006	50.080	3,756,300.480	
BEIERSDORF AG	8,371	95.920	802,946.320	
HOCHTIEF AG	1,707	80.850	138,010.950	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	49.330	593,489.230	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,156	74.700	1,356,253.200	
ORANGE	161,909	10.495	1,699,234.950	
SAMPO OYJ-A SHS	40,807	32.180	1,313,169.260	
RANDSTAD NV	9,074	40.810	370,309.940	
ALLIANZ SE	35,090	182.680	6,410,241.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	4.536	914,484.810	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	92,232	24.480	2,257,839.360	
HERMES INTL	2,676	770.000	2,060,520.000	

ENDESA S.A.	29,748	23.860	709,787.280	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	8.648	139,198.200	
ERSTE GROUP BANK AG	27,125	22.130	600,276.250	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,862	230.500	2,734,191.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	9.900	609,780.600	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,824	156.300	1,691,791.200	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	23.790	479,059.230	
HEINEKEN NV	21,110	84.500	1,783,795.000	
AKZO NOBEL	16,843	80.820	1,361,251.260	
ASML HOLDING NV	35,598	348.700	12,413,022.600	
AEGON NV	150,349	2.754	414,061.140	
BANKINTER S.A.	57,960	4.274	247,721.040	
VOLKSWAGEN AG	2,758	147.300	406,253.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,582	139.980	2,181,168.360	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	556,319	3.146	1,750,179.570	
KERING	6,324	499.750	3,160,419.000	
CNP ASSURANCES	13,987	10.780	150,779.860	
FORTUM OYJ	39,409	17.340	683,352.060	
AGEAS	14,365	33.820	485,824.300	
UCB SA	10,571	107.150	1,132,682.650	
NEMETSCHEK SE	5,095	63.450	323,277.750	
THYSSENKRUPP AG	27,110	6.504	176,323.440	
CARREFOUR SA	49,926	13.470	672,503.220	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	16.760	395,737.120	
ATOS SE	7,304	77.080	562,992.320	
NOKIA OYJ	473,158	3.646	1,725,134.060	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	76,344	41.565	3,173,238.360	
WOLTERS KLUWER-CVA	22,583	69.980	1,580,358.340	
SANOFI	94,410	88.920	8,394,937.200	
STMICROELECTRONICS NV	56,474	25.360	1,432,180.640	
ELISA OYJ	10,787	55.240	595,873.880	
BANCO SANTANDER SA	1,388,012	2.220	3,081,386.640	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	16.900	584,672.400	
QIAGEN N.V.	17,974	39.670	713,028.580	
DEUTSCHE BANK AG-REG	166,418	8.825	1,468,638.850	
BMW VORZUG	4,116	44.300	182,338.800	
ENEL SPA	670,875	8.030	5,387,126.250	
COLRUYT NV	4,673	49.380	230,752.740	
VOPAK (KON.)	5,364	48.520	260,261.280	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	277,656	14.910	4,139,850.960	
SARTORIUS AG	3,038	308.000	935,704.000	
LEONARDO SPA	28,316	5.618	159,079.280	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	77.500	595,665.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	101,376	22.550	2,286,028.800	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	89.900	339,012.900	

KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.381	692,940.040	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,133	536.000	607,288.000	
TELEPERFORMANCE	5,018	225.300	1,130,555.400	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,488	166.100	2,572,556.800	
EURAZEO	2,748	45.080	123,879.840	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	75.340	503,949.260	
FRAPORT AG	3,149	37.400	117,772.600	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	75.900	759,303.600	
INDITEX	93,287	23.130	2,157,728.310	
JC DECAUX SA	6,058	15.510	93,959.580	
ANDRITZ AG	6,265	30.920	193,713.800	
MAPFRE SA	84,474	1.605	135,580.770	
ESSILORLUXOTTICA	23,278	116.950	2,722,362.100	
SNAM SPA	171,294	4.448	761,915.710	
CREDIT AGRICOLE SA	105,610	8.852	934,859.720	
ORPEA	4,892	100.050	489,444.600	
ENAGAS	18,095	21.300	385,423.500	
WENDEL	2,220	82.700	183,594.000	
TENARIS SA	36,959	5.576	206,083.380	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.344	262,360.200	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.340	169,182.640	
ATLANTIA SPA	37,690	13.395	504,857.550	
ILIAD SA	1,046	175.950	184,043.700	
PROXIMUS	13,739	18.055	248,057.640	
SES FDR	28,847	6.300	181,736.100	
TERNA SPA	113,654	6.124	696,017.090	
BIOMERIEUX	3,248	126.500	410,872.000	
GRIFOLS SA	23,518	26.200	616,171.600	
FERROVIAL SA	40,192	23.210	932,856.320	
LANXESS AG	6,856	48.020	329,225.120	
NESTE OYJ	33,181	35.640	1,182,570.840	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	16.530	159,365.730	
RECORDATI SPA	9,977	45.600	454,951.200	
GALAPAGOS NV	3,426	171.600	587,901.600	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	58,858	8.143	479,280.690	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	153.100	638,120.800	
KONE OYJ	28,802	62.580	1,802,429.160	
ELIA GROUP	2,862	95.600	273,607.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,554	238.400	608,873.600	
ENGIE	150,782	10.930	1,648,047.260	
ALSTOM	15,712	44.040	691,956.480	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	36.800	133,731.200	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,173	9.242	399,004.860	
IPSEN SA	3,646	79.650	290,403.900	
DEUTSCHE WOHNEN	30,347	40.360	1,224,804.920	
ARKEMA SA	4,996	87.080	435,051.680	

LEGRAND SA	22,725	68.540	1,557,571.500	
UNILEVER NV	120,278	46.280	5,566,465.840	
ADP	2,313	92.750	214,530.750	
ORION OYJ	8,051	44.730	360,121.230	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	10.465	419,520.920	
SYMRISE AG	11,342	106.400	1,206,788.800	
SCOR SE	15,667	23.840	373,501.280	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	27.540	479,113.380	
PRYSMIAN SPA	22,328	21.450	478,935.600	
DIASORIN SPA	2,223	172.900	384,356.700	
CAIXABANK	307,331	1.994	612,818.010	
BUREAU VERITAS SA	23,179	19.545	453,033.550	
GETLINK	37,646	13.390	504,079.940	
SUEZ SA	26,620	10.655	283,636.100	
AMADEUS IT GROUP SA	36,643	45.740	1,676,050.820	
BRENTAG AG	12,353	51.580	637,167.740	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	23.760	406,676.160	
EDENRED	19,188	41.500	796,302.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.519	247,831.810	
LEG IMMOBILIEN AG	5,934	117.340	696,295.560	
KION GROUP AG	4,567	59.260	270,640.420	
VONOVIA SE	43,493	55.320	2,406,032.760	
KNORR-BREMSE AG	4,265	93.500	398,777.500	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	41.755	478,846.340	
FERRARI NV	10,809	157.000	1,697,013.000	
METRO AG	10,774	8.134	87,635.710	
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	6.056	472,071.250	
AROUNDTOWN SA	113,665	5.200	591,058.000	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	27.410	221,801.720	
MONCLER SPA	14,353	34.160	490,298.480	
NEXI SPA	33,176	15.635	518,706.760	
TEAMVIEWER AG	11,117	51.180	568,968.060	
PROSUS NV	40,745	86.360	3,518,738.200	
IBERDROLA SA-RTS	490,508	0.241	118,212.420	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	20,128	1.451	29,205.720	
REPSOL SA-RTS	117,630	0.443	52,110.090	
WORLDLINE SA	11,987	77.480	928,752.760	
NN GROUP NV	26,416	31.990	845,047.840	
FINECOBANK SPA	45,048	12.550	565,352.400	
ZALANDO SE	13,039	65.160	849,621.240	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	97,919	8.833	864,918.520	
AENA SME SA	5,338	120.000	640,560.000	
CELLNEX TELECOM SAU	19,780	57.080	1,129,042.400	

	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,381	94.080	976,644.480	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	8.082	276,816.580	
	EXOR NV	7,971	49.610	395,441.310	
	ALTICE EUROPE NV	56,763	3.597	204,176.510	
	SCOUT24 AG	9,663	72.650	702,016.950	
	COVESTRO AG	17,056	35.190	600,200.640	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	62,590	47.180	2,952,996.200	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	7.690	307,715.350	
	AMUNDI SA	4,119	69.850	287,712.150	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.215	215,114.960	
	ADYEN NV	1,520	1,379.500	2,096,840.000	
	PIRELLI & C SPA	34,086	3.715	126,629.490	
	UNIPER SE	14,388	29.940	430,776.720	
	DELIVERY HERO SE	10,880	95.140	1,035,123.200	
ユーロ 小計		16,258,701		314,653,926.780 (38,035,366,669)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	100.100	3,293,290.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	20.700	3,394,800.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	17.700	1,838,322.000	
	CLP HOLDINGS LTD	134,500	73.900	9,939,550.000	
	PCCW LTD	331,000	4.390	1,453,090.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	39.900	1,975,050.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	100,740	363.800	36,649,212.000	
	MTR CORP	126,000	39.750	5,008,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	64,900	129.200	8,385,080.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	30.050	3,469,272.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	103,500	43.150	4,466,025.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	893,292	11.780	10,522,979.760	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	177,000	50.700	8,973,900.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	68,500	20.500	1,404,250.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	22.950	7,286,625.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	6.530	881,550.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	121,066	40.700	4,927,386.200	
	SINO LAND CO	255,400	10.000	2,554,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	109,000	98.200	10,703,800.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	41.900	2,074,050.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	116,000	79.500	9,222,000.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.330	1,299,480.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	13.280	1,652,032.000	
	AIA GROUP LTD	1,012,227	75.100	76,018,247.700	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	11.500	3,323,500.000	

SANDS CHINA LTD	198,800	30.300	6,023,640.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	18.640	1,942,288.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	33.200	3,178,900.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.900	1,817,000.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	23.050	3,471,330.000	
WH GROUP LTD	731,500	7.050	5,157,075.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	227,332	50.350	11,446,166.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	220,332	46.100	10,157,305.200	
香港・ドル 小計	7,108,749		263,909,696.560 (3,636,675,619)	
合計	89,678,287		344,037,314,451 (344,037,314,451)	

(2) 株式以外の有価証券

令和2年7月13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	84,575.000	774,707.000	
		GOODMAN GROUP	134,222.000	2,045,543.280	
		GPT GROUP	158,232.000	658,245.120	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	701,660.340	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	890,968.160	
		STOCKLAND	194,018.000	624,737.960	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	356,984.760	
	オーストラリア・ドル 小計		1,591,176.000	6,052,846.620 (449,302,804)	
	シンガポール・ ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	272,806.000	889,347.560	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	363,088.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	401,980.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	376,908.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	287,400.000	580,548.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	276,624.000	
シンガポール・ドル 小計		1,349,906.000	2,888,495.560 (222,096,424)		
投資信託受益証券 合計		2,941,082	671,399,228 (671,399,228)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	585,015.880	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,597.000	1,704,103.570	
		AMERICAN TOWER CORP	37,025.000	9,787,558.750	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	109,087.000	724,337.680	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,231.000	1,715,422.940	
	BOSTON PROPERTIES INC	13,487.000	1,178,628.930	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,458.000	755,891.460	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	34,148.000	5,856,382.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	21,885.000	3,225,630.150	
	DUKE REALTY TRUST	31,185.000	1,116,111.150	
	EQUINIX INC	7,004.000	5,018,996.360	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	852,987.600	
	EQUITY RESIDENTIAL	32,056.000	1,817,575.200	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,736.000	1,292,492.880	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,566.000	1,016,977.500	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	479,700.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41,581.000	1,108,549.460	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	597,457.440	
	INVITATION HOMES INC	42,384.000	1,167,679.200	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	657,563.340	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	39,953.000	708,366.690	
	MID AMERICA	8,932.000	1,014,675.200	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	456,422.560	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	543,259.470	
	PROLOGIS INC	61,839.000	5,863,573.980	
	PUBLIC STORAGE	12,738.000	2,476,649.340	
	REALTY INCOME CORP	28,267.000	1,610,936.330	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	622,587.060	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,254.000	2,817,102.680	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,461.000	1,628,994.780	
	SUN COMMUNITIES INC	7,418.000	1,005,509.900	
	UDR INC	25,967.000	939,486.060	
	VENTAS INC	31,091.000	1,114,923.260	
	VEREIT INC	82,604.000	512,970.840	
	VICI PROPERTIES INC	41,789.000	834,108.440	
	VORNADO REALTY TRUST	12,714.000	457,704.000	
	WELLTOWER INC	34,875.000	1,762,931.250	
	WEYERHAEUSER CO	65,842.000	1,559,796.980	
	WP CAREY INC	15,548.000	1,030,987.880	
アメリカ・ドル	小計	1,112,002.000	67,620,048.190 (7,224,525,948)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	264,125.270	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	307,918.300	
	SEGRO PLC	87,247.000	817,155.400	
イギリス・ポンド	小計	212,909.000	1,389,198.970 (187,527,969)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	378,689.940	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,935.000	172,552.900	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	200,523.630	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	62,720.150	
カナダ・ドル	小計	37,423.000	814,486.620 (64,059,373)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	306,125.950	
	GECINA SA	3,670.000	395,626.000	
	ICADE	2,234.000	135,380.400	
	KLEPIERRE	17,099.000	276,405.330	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	663,571.200	
ユーロ	小計	40,586.000	1,777,108.880 (214,816,921)	
香港・ドル	LINK REIT	172,500.000	10,910,625.000	
香港・ドル	小計	172,500.000	10,910,625.000 (150,348,413)	
投資証券	合計	1,575,420	7,841,278,624 (7,841,278,624)	
合計			8,512,677,852 (8,512,677,852)	

(注) 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 590銘柄	68.31	-	-	71.62
	投資証券 39銘柄	-	-	2.01	
イギリス・ポンド	株式 84銘柄	4.56	-	-	4.70
	投資証券 3銘柄	-	-	0.05	
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 58銘柄	2.08	-	-	2.25
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 81銘柄	3.28	-	-	3.36
	投資証券 4銘柄	-	-	0.02	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.32	-	-	0.39
	投資信託受益証券 6銘柄	-	0.06	-	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.45	-	-	3.51
スウェーデン・クローナ	株式 36銘柄	1.03	-	-	1.05
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.80	-	-	0.81
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.11	-	-	0.11
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.17	-	-	0.18
ユーロ	株式 242銘柄	10.59	-	-	10.85
	投資証券 5銘柄	-	-	0.06	
香港・ドル	株式 33銘柄	1.01	-	-	1.07
	投資証券 1銘柄	-	-	0.04	

（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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,082,362,288
投資証券	40,869,783,920
未収配当金	304,965,901
前払金	41,710,400
差入委託証拠金	113,708,000
流動資産合計	42,412,530,509
資産合計	42,412,530,509
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,886,040
未払金	515,030,993
未払解約金	76,246,000
流動負債合計	630,163,033
負債合計	630,163,033
純資産の部	
元本等	
元本	22,172,930,883
剰余金	
剰余金又は欠損金()	19,609,436,593
元本等合計	41,782,367,476
純資産合計	41,782,367,476
負債純資産合計	42,412,530,509

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
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	令和2年7月13日現在
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	17,388,243,328円
同期中追加設定元本額	17,335,601,530円
同期中一部解約元本額	12,550,913,975円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	373,212円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,009,699円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,091,484円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	4,116,199円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	3,968,750円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,827,112円
たわらノーロード 国内リート	4,065,365,856円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,072,958,634円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	617,884,823円
たわらノーロード バランス(堅実型)	11,171,100円
たわらノーロード バランス(標準型)	191,981,980円
たわらノーロード バランス(積極型)	199,611,973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)	36,161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)	98,881,330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)	195,025,212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)	102,424,948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)	130,523,679円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,134,702円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,175,435円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,309,296円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,919,602円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,809,922円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	350,338,871円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	121,912,674円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	131,994,633円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	250,698,560円
投資のソムリエ	4,159,292,479円
投資のソムリエ<DC年金>	387,564,139円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	116,385,910円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	80,694,275円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	742,892,334円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,919,857円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,741,770円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	763,157円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	8,516,955円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	329,859,392円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	97,804,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,348,029円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	594,976円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	614,023円
Jリートインデックスファンド(DC)	30,724,466円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	85,802,270円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	770,651,758円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	78,912,154円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	272,570,473円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	96,673,199円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	5,138,807,386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)	393,572,589円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	123,135,452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)	1,666,841,804円
計	22,172,930,883円
2. 受益権の総数	22,172,930,883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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	1,923,745,933
合計	1,923,745,933

(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(令和2年6月9日から令和2年7月13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	令和2年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	905,000,400	-	866,172,000	38,828,400
合計	905,000,400	-	866,172,000	38,828,400

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

- 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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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)

令和2年7月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8844円 (18,844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

令和2年7月13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	1,074	165,610,800	
	GLP投資法人	12,221	1,999,355,600	
	MCUBS MidCity投 資法人	6,059	419,282,800	
	Oneリート投資法人	736	181,276,800	
	SOSILA物流リート投資法 人	1,052	155,696,000	
	いちごオフィスリート投資法人	3,657	253,795,800	
	いちごホテルリート投資法人	782	49,969,800	
	さくら総合リート投資法人	1,022	77,365,400	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	2,366	818,636,000	
	アドバンス・レジデンス投資法 人	4,479	1,569,889,500	
	イオンリート投資法人	5,097	557,611,800	

インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	30,341	382,296,600	
インヴィンシブル投資法人	20,716	537,994,520	
エスコンジャパンリート投資法人	574	63,541,800	
オリックス不動産投資法人	9,410	1,307,049,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,279	324,293,100	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,461	883,905,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	3,081	606,648,900	
ケネディクス商業リート投資法人	1,824	350,390,400	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,056	713,432,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	945	96,957,000	
サンケイリアルエステート投資法人	684	66,621,600	
ザイマックス・リート投資法人	685	60,280,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	15,214	695,279,800	
ジャパンエクセレント投資法人	4,368	491,836,800	
ジャパンリアルエステイト投資法人	4,723	2,607,096,000	
スターアジア不動産投資法人	1,567	135,545,500	
スターツプロシード投資法人	735	156,628,500	
タカラレーベン不動産投資法人	1,340	113,900,000	
トーセイ・リート投資法人	1,028	104,239,200	
ヒューリックリート投資法人	4,016	497,582,400	
フロンティア不動産投資法人	1,677	545,863,500	
プレミアム投資法人	4,266	476,085,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,007	121,847,000	
マリモ地方創生リート投資法人	466	45,295,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	10,604	1,178,104,400	
ラサールロジポート投資法人	4,391	787,306,300	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	983	151,480,300	
阪急阪神リート投資法人	2,133	253,400,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,344	692,160,000	
三菱地所物流リート投資法人	930	402,690,000	
産業ファンド投資法人	6,082	1,158,012,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,108	105,703,200	
森トラスト総合リート投資法人	3,375	425,925,000	
森ヒルズリート投資法人	5,434	755,326,000	
星野リゾート・リート投資法人	719	316,360,000	

積水ハウス・リート投資法人	13,809	976,296,300	
大江戸温泉リート投資法人	802	49,964,600	
大和ハウスリート投資法人	6,738	1,870,468,800	
大和証券オフィス投資法人	1,090	622,390,000	
大和証券リビング投資法人	5,781	604,114,500	
投資法人みらい	5,371	192,818,900	
東急リアル・エステート投資法人	3,166	437,224,600	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,569	1,066,920,000	
日本ビルファンド投資法人	4,573	2,707,216,000	
日本プライムリアルティ投資法人	3,104	907,920,000	
日本プロロジスリート投資法人	7,106	2,366,298,000	
日本リート投資法人	1,534	480,142,000	
日本リテールファンド投資法人	8,926	1,180,017,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	3,086	938,144,000	
福岡リート投資法人	2,442	298,168,200	
平和不動産リート投資法人	2,941	284,394,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	15,246	2,027,718,000	
投資証券 合計	278,395	40,869,783,920	
合計		40,869,783,920	

（注）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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	474,511,858
コール・ローン	121,467,500
投資信託受益証券	4,135,098,936
投資証券	33,742,859,812
派生商品評価勘定	1,064
未収配当金	149,130,012
流動資産合計	38,623,069,182
資産合計	38,623,069,182
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,600
未払金	434,639,652
未払解約金	745,000
流動負債合計	435,494,252
負債合計	435,494,252
純資産の部	
元本等	
元本	35,553,004,720
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,634,570,210
元本等合計	38,187,574,930
純資産合計	38,187,574,930
負債純資産合計	38,623,069,182

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
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 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>為替予約取引 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、計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	令和2年7月13日現在
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	29,640,253,704円
同期中追加設定元本額	35,829,265,519円
同期中一部解約元本額	29,916,514,503円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E 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)	65,995,162円
D I A M先進国 R E 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)	28,503,443円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,032,257円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	16,380,961円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	17,586,179円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	66,567,083円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	64,408,021円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	29,442,500円
たわらノーロード 先進国リート	6,689,832,294円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	884,173,965円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	304,343,577円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,079,149,420円
たわらノーロード バランス(堅実型)	9,624,870円

たわらノーロード バランス(標準型)	166,710,380円
たわらノーロード バランス(積極型)	318,512,865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)	73,794,932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)	264,142,615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)	178,233,109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)	295,512,376円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,316,981円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	6,463,733円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,021,191円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	9,790,798円
One DC 先進国リートインデックスファンド	82,812,007円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,914,119円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	623,478,643円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	54,446,524円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	220,950,023円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	238,890,973円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	440,162,846円
投資のソムリエ	4,112,034,505円
投資のソムリエ<DC年金>	381,030,321円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	207,835,560円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	278,683,494円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,575,429,338円
ワールドアセットバランス(基本コース)	812,123,062円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	834,776,955円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	3,817,650円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,168,199円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,652,870円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,440,570円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,263,558,370円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,223,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,047,363円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	460,840円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	479,731円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	664,483,683円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	97,522,040円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	384,722,019円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	1,097,495,508円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	467,607,215円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	608,047,101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)	179,501,830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)	356,575,944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)	3,800,527,901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)	4,418,271,468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)	556,293,354円
計	35,553,004,720円
2. 受益権の総数	35,553,004,720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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	138,287,960
投資証券	769,319,836
合計	907,607,796

(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(令和2年6月23日から令和2年7月13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	令和2年7月13日現在			
	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	45,241,786	-	45,133,250	108,536
オーストラリア・ドル	26,776,800	-	26,719,200	57,600
シンガポール・ドル	7,716,000	-	7,688,000	28,000
ニュージーランド・ドル	2,456,986	-	2,458,050	1,064
香港・ドル	8,292,000	-	8,268,000	24,000
合計	45,241,786	-	45,133,250	108,536

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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)

	令和2年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0741円 (10,741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

令和2年7月13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	アメリカ・ドル	ARA US HOSPITALITY TRUST	155,100.000	60,489.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	492,600.000	371,913.000	

	PRIME US REIT	143,600.000	114,162.000	
アメリカ・ドル	小計	864,000.000	546,564.000 (58,394,898)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	117,480.000	300,748.800	
	APN INDUSTRIA REIT	41,907.000	98,900.520	
	ARENA REIT	93,469.000	208,435.870	
	BWP TRUST	166,786.000	638,790.380	
	CENTURIA OFFICE REIT	115,908.000	227,759.220	
	CHARTER HALL GROUP	151,961.000	1,446,668.720	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	143,346.000	619,254.720	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	159,226.000	512,707.720	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	94,767.000	216,068.760	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	622,702.000	551,091.270	
	DEXUS	361,580.000	3,312,072.800	
	GDI PROPERTY GROUP	176,140.000	186,708.400	
	GOODMAN GROUP	537,961.000	8,198,525.640	
	GPT GROUP	646,020.000	2,687,443.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	99,137.000	319,221.140	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	50,661.000	145,397.070	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	95,299.000	418,362.610	
	MIRVAC GROUP	1,304,359.000	2,778,284.670	
	NATIONAL STORAGE REIT	326,036.000	611,317.500	
	RURAL FUNDS GROUP	101,989.000	204,997.890	
	SCENTRE GROUP	1,719,241.000	3,644,790.920	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	352,426.000	771,812.940	
	STOCKLAND	790,876.000	2,546,620.720	
	VICINITY CENTRES	1,268,762.000	1,674,765.840	
	WAYPOINT REIT LTD	233,137.000	594,499.350	
オーストラリア・ドル	小計	9,771,176.000	32,915,246.670 (2,443,298,760)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	140,595.000	165,902.100	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	310,780.000	188,021.900	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	981,760.000	3,200,537.600	
	ASCOTT TRUST	615,416.000	633,878.480	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	930,579.000	1,637,819.040	
	CAPITALAND MALL TRUST	924,960.000	1,868,419.200	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	259,280.000	331,878.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	275,600.000	294,892.000	

		ESR REIT	702,630.000	274,025.700	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	271,300.000	142,432.500	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	180,100.000	130,572.500	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	240,300.000	569,511.000	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	235,700.000	114,314.500	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	793,164.000	967,660.080	
		KEPPEL DC REIT	400,400.000	1,049,048.000	
		KEPPEL REIT	641,400.000	699,126.000	
		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	243,100.000	159,230.500	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	615,000.000	84,870.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	701,600.000	1,375,136.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	495,420.000	1,471,397.400	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	976,620.000	1,972,772.400	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	683,500.000	645,907.500	
		OUÉ COMMERCIAL REIT	850,255.000	335,850.720	
		PARKWAY LIFE REIT	130,900.000	441,133.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	286,200.000	103,032.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	165,200.000	127,204.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	275,000.000	112,750.000	
		SPH REIT	277,400.000	244,112.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	443,900.000	235,267.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	760,690.000	1,095,393.600	
		シンガポール・ドル 小計	14,808,749.000	20,672,095.120 (1,589,477,394)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	462,000.000	3,187,800.000	
		香港・ドル 小計	462,000.000	3,187,800.000 (43,927,884)	
投資信託受益証券 合計			25,905,925	4,135,098,936 (4,135,098,936)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	27,454.000	335,762.420	
		AGREE REALTY CORP	17,550.000	1,120,918.500	
		ALEXANDER'S INC.	658.000	157,479.140	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	41,709.000	6,707,224.290	

AMERICAN ASSETS TRUST INC	15,258.000	414,712.440	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	45,696.000	1,484,663.040	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	36,384.000	261,600.960	
AMERICAN HOMES 4 RENT	84,589.000	2,246,683.840	
AMERICOLD REALTY TRUST	66,351.000	2,438,399.250	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	49,374.000	1,836,219.060	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	69,107.000	628,182.630	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,083.000	5,758.620	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	46,510.000	7,103,937.400	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,102.000	57,686.240	
BOSTON PROPERTIES INC	47,795.000	4,176,805.050	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,335.000	12,910.700	
BRANDYWINE REALTY TRUST	56,208.000	587,373.600	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	96,568.000	1,169,438.480	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	18,012.000	200,473.560	
BRT APARTMENTS CORP	3,832.000	39,776.160	
CAMDEN PROPERTY TRUST	32,242.000	2,881,467.540	
CARETRUST REIT INC	31,754.000	529,656.720	
CBL & ASSOCIATES	14,685.000	3,744.670	
CEDAR REALTY TRUST INC	13,779.000	13,365.630	
CHATHAM LODGING TRUST	15,244.000	85,671.280	
CITY OFFICE REIT INC	15,658.000	148,594.420	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	36,720.920	
COLONY CAPITAL INC	153,032.000	359,625.200	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	37,832.000	463,063.680	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,904.000	287,965.840	
CORECIVIC INC	39,646.000	366,725.500	
COREPOINT LODGING INC	13,648.000	61,552.480	
CORESITE REALTY CORP	13,377.000	1,642,829.370	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	36,635.000	925,400.100	
COUSINS PROPERTIES INC	49,338.000	1,411,560.180	
CUBESMART	64,220.000	1,758,343.600	
CYRUSONE INC	38,141.000	2,902,339.390	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	66,396.000	345,923.160	
DIGITAL REALTY TRUST INC	88,624.000	13,062,291.360	

DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	79,356.000	303,139.920	
DOUGLAS EMMETT INC	54,716.000	1,639,291.360	
DUKE REALTY TRUST	121,844.000	4,360,796.760	
EAST GROUP	12,966.000	1,527,783.780	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	24,681.000	564,701.280	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	45,046.000	301,808.200	
EPR PROPERTIES	25,326.000	806,379.840	
EQUINIX INC	29,229.000	20,945,209.110	
EQUITY COMMONWEALTH	39,576.000	1,236,750.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	60,261.000	3,772,338.600	
EQUITY RESIDENTIAL	115,614.000	6,555,313.800	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	30,552.000	450,336.480	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,632.000	4,874,338.560	
EXTRA SPACE STORAGE INC	42,701.000	4,109,971.250	
FARMLAND PARTNERS INC	9,378.000	63,957.960	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,328.000	1,865,073.600	
FIRST INDUSTRIAL RT	42,221.000	1,617,486.510	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	23,330.000	540,322.800	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,124.000	163,632.560	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	15,771.000	130,268.460	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	68,569.000	2,260,719.930	
GEO GROUP INC	38,508.000	456,704.880	
GETTY REALTY CORP	11,459.000	330,821.330	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,478.000	187,137.080	
GLADSTONE LAND CORP	6,064.000	95,629.280	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,189.000	134,200.890	
GLOBAL NET LEASE INC	30,059.000	486,054.030	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	43,944.000	1,233,068.640	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	72,456.000	1,862,119.200	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	178,001.000	4,745,506.660	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	12,444.000	68,690.880	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	33,842.000	1,219,665.680	
HOST HOTELS & RESORTS INC	233,519.000	2,531,345.960	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	49,937.000	1,198,488.000	

INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	31,548.000	344,819.640	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	21,517.000	436,364.760	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	6,984.000	634,007.520	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,909.000	281,448.000	
INVITATION HOMES INC	179,807.000	4,953,682.850	
IRON MOUNTAIN INC	95,363.000	2,550,006.620	
JBG SMITH PROPERTIES	38,329.000	1,117,673.640	
KILROY REALTY CORP	35,098.000	2,031,472.240	
KIMCO REALTY	143,499.000	1,736,337.900	
KITE REALTY GROUP TRUST	28,114.000	292,666.740	
LEXINGTON REALTY TRUST	90,183.000	937,903.200	
LIFE STORAGE INC	15,577.000	1,501,311.260	
LTC PROPERTIES INC	12,916.000	480,733.520	
MACK CALI	28,751.000	416,314.480	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	174,873.000	3,100,498.290	
MID AMERICA	37,823.000	4,296,692.800	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	31,072.000	432,522.240	
NATIONAL HEALTH INVS INC	14,585.000	820,260.400	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	57,020.000	1,906,748.800	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	20,356.000	584,217.200	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	27,590.000	87,184.400	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,893.000	233,603.770	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	15,941.000	392,945.650	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	75,195.000	2,298,711.150	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,097.000	89,656.230	
PARAMOUNT GROUP INC	63,471.000	461,434.170	
PARK HOTELS & RESORTS INC	77,456.000	747,450.400	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	42,953.000	491,811.850	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	24,870.000	31,833.600	
PHYSICIANS REALTY TRUST	66,026.000	1,108,576.540	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	41,442.000	644,423.100	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,986.000	61,975.980	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	14,783.000	107,324.580	

PROLOGIS INC	243,879.000	23,124,606.780	
PS BUSINESS PARKS	6,583.000	868,231.870	
PUBLIC STORAGE	49,663.000	9,655,977.090	
QTS REALTY TRUST INC	19,630.000	1,266,331.300	
REALTY INCOME CORP	113,505.000	6,468,649.950	
REGENCY CENTERS CORP	56,195.000	2,413,013.300	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	38,427.000	393,300.340	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	72,012.000	479,599.920	
RETAIL VALUE INC	5,004.000	58,746.960	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	40,706.000	1,703,139.040	
RLJ LODGING TRUST	54,924.000	471,247.920	
RPT REALTY	25,390.000	160,718.700	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18,220.000	573,019.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	67,103.000	949,507.450	
SAFEHOLD INC	4,045.000	213,454.650	
SAUL CENTERS INC	3,788.000	116,367.360	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11,696.000	119,182.240	
SERVICE PROPERTIES TRUST	54,759.000	346,076.880	
SIMON PROPERTY GROUP INC	101,055.000	6,465,498.900	
SITE CENTERS CORP	49,438.000	371,773.760	
SL GREEN	24,941.000	1,199,911.510	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	33,550.000	1,085,678.000	
STAG INDUSTRIAL INC	49,391.000	1,447,650.210	
STORE CAPITAL CORP	73,841.000	1,633,362.920	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	35,881.000	198,780.740	
SUN COMMUNITIES INC	32,501.000	4,405,510.550	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	71,515.000	557,817.000	
TANGER FACTORY OUTLET	28,639.000	189,590.180	
TAUBMAN CENTERS INC	20,247.000	758,047.680	
TERRENO REALTY CORP	22,061.000	1,174,527.640	
THE MACERICH COMPANY	38,636.000	326,860.560	
UDR INC	97,578.000	3,530,372.040	
UMH PROPERTIES INC	11,534.000	137,485.280	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,227.000	288,746.370	
URBAN EDGE PROPERTIES	35,207.000	389,389.420	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9,558.000	98,351.820	
VENTAS INC	123,394.000	4,424,908.840	
VEREIT INC	357,200.000	2,218,212.000	

	VICI PROPERTIES INC	155,120.000	3,096,195.200	
	VORNADO REALTY TRUST	52,604.000	1,893,744.000	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	49,273.000	36,166.380	
	WASHINGTON REIT	27,123.000	598,604.610	
	WEINGARTEN REALTY INVST	39,584.000	695,886.720	
	WELLTOWER INC	137,977.000	6,974,737.350	
	WHITESTONE REIT	13,415.000	88,136.550	
	WP CAREY INC	57,040.000	3,782,322.400	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	37,842.000	329,603.820	
アメリカ・ドル	小計	7,343,865.000	264,303,556.410 (28,238,191,966)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	54,933.000	39,332.020	
	ASSURA PLC	869,514.000	673,003.830	
	BIG YELLOW GROUP PLC	53,508.000	529,729.200	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	275,355.000	163,836.220	
	BRITISH LAND CO PLC	312,622.000	1,182,649.020	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	282,246.000	413,772.630	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	9,186.000	7,532.520	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	208,783.000	227,991.030	
	DERWENT LONDON PLC	35,353.000	1,023,115.820	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	186,961.000	113,859.240	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	83,235.000	503,904.690	
	HAMMERSON PLC	257,556.000	189,303.660	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	3,927.680	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	249,225.000	1,374,226.650	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	297,176.000	652,004.140	
	LXI REIT PLC	178,449.000	202,004.260	
	NEWRIVER REIT PLC	102,138.000	61,282.800	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	170,446.000	115,221.490	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	397,419.000	600,102.690	
	RDI REIT PLC	74,051.000	60,425.610	
	REGIONAL REIT LTD	129,740.000	94,839.940	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	68,939.000	521,178.840	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	187,713.000	60,443.580	
	SEGRO PLC	393,871.000	3,688,995.780	
	SHAFTESBURY PLC	73,548.000	376,198.020	

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	110,038.000	111,688.570	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	557,069.000	827,804.530	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	287,008.000	178,231.960	
	UNITE GROUP PLC	132,181.000	1,241,179.590	
	WORKSPACE GROUP PLC	42,431.000	263,496.510	
イギリス・ボンド 小計		6,311,734.000	15,501,282.520 (2,092,518,127)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	55,436.000	732,863.920	
イスラエル・シュケル 小計		55,436.000	732,863.920 (22,638,166)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	19,809.000	821,677.320	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,186.000	156,140.820	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,095.000	205,542.150	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	27,243.000	1,297,039.230	
	CHOICE PROPERTIES REIT	50,155.000	640,980.900	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	29,065.000	232,810.650	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	15,823.000	204,433.160	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,582.000	224,686.100	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	25,332.000	272,572.320	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,627.000	173,402.700	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	36,184.000	482,694.560	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,327.000	661,191.030	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	47,613.000	456,132.540	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22,749.000	325,538.190	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,345.000	281,134.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,391.000	123,218.480	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,002.000	85,948.640	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	10,979.000	381,410.460	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,707.000	298,681.460	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	51,069.000	760,417.410	
SLATE OFFICE REIT	11,634.000	41,998.740		
SLATE RETAIL REIT	5,623.000	51,056.840		

	SMARTCENTRES REIT	23,501.000	480,595.450	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	22,517.000	255,117.610	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	12,414.000	69,766.680	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,888.000	244,706.560	
カナダ・ドル 小計		544,860.000	9,228,894.000 (725,852,513)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	279,169.000	339,190.330	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	360,069.000	772,348.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	520,561.000	536,177.830	
	PRECINCT PROPERTIES	363,886.000	600,411.900	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	106,603.000	271,837.650	
ニュージーランド・ドル 小計		1,630,288.000	2,519,965.710 (177,002,391)	
ユーロ	AEDIFICA	8,830.000	865,340.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	52,383.000	688,312.620	
	ALTAREA	1,370.000	164,948.000	
	BEFIMMO	7,338.000	285,448.200	
	COFINIMMO SA	8,170.000	1,013,080.000	
	COVIVIO	16,278.000	1,068,650.700	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,345.000	152,933.700	
	GECINA SA	16,655.000	1,795,409.000	
	HAMBORNER REIT AG	22,681.000	196,213.330	
	HIBERNIA REIT PLC	225,286.000	246,462.880	
	ICADE	9,711.000	588,486.600	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	14,335.000	49,455.750	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	80,424.000	634,947.480	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,501.000	168,397.450	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	135,199.000	194,686.560	
	KLEPIERRE	69,476.000	1,123,079.540	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	18,634.000	85,250.550	
	MERCIALYS	11,266.000	80,608.230	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	122,004.000	891,849.240	
	MONTEA SCA	3,498.000	334,758.600	
	NSI NV	5,685.000	192,153.000	
RETAIL ESTATES	3,620.000	224,440.000		
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	45,935.000	2,359,221.600		
VASTNED RETAIL	5,849.000	115,576.240		

	WAREHOUSES DE PAUW	43,011.000	1,092,264.340	
	WERELDHAVE NV	13,365.000	108,323.320	
ユーロ 小計		961,849.000	14,720,296.930 (1,779,389,493)	
韓国・ウォン	LOTTE REIT CO LTD	29,079.000	152,664,750.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10,894.000	71,137,820.000	
韓国・ウォン 小計		39,973.000	223,802,570.000 (19,918,429)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	665,070.000	2,839,848.900	
	LINK REIT	680,320.000	43,030,240.000	
	PROSPERITY REIT	408,000.000	942,480.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	342,000.000	1,337,220.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	482,000.000	1,730,380.000	
香港・ドル 小計		2,577,390.000	49,880,168.900 (687,348,727)	
投資証券 合計		19,465,395	33,742,859,812 (33,742,859,812)	
合計			37,877,958,748 (37,877,958,748)	

(注) 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	投資信託受益証券 4銘柄	0.15	-	74.70
	投資証券 153銘柄	-	73.95	
イギリス・ポンド	投資証券 30銘柄	-	5.48	5.52
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.06	0.06
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	6.40	-	6.45
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	-	1.90	1.92
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	4.16	-	4.20
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.46	0.47
ユーロ	投資証券 26銘柄	-	4.66	4.70
韓国・ウォン	投資証券 2銘柄	-	0.05	0.05
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.12	-	1.93
	投資証券 5銘柄	-	1.80	

(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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,608,675,094
コール・ローン	99,447,134
国債証券	111,297,690,202
未収利息	947,075,002
前払費用	649,894,800
流動資産合計	114,602,782,232
資産合計	114,602,782,232
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,513
未払金	232,911,200
未払解約金	1,868,000
流動負債合計	234,790,713
負債合計	234,790,713
純資産の部	
元本等	
元本	55,964,742,243
剰余金	
剰余金又は欠損金()	58,403,249,276
元本等合計	114,367,991,519
純資産合計	114,367,991,519
負債純資産合計	114,602,782,232

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月13日現在
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	65,968,862,023円
同期中追加設定元本額	58,155,284,872円
同期中一部解約元本額	68,159,404,652円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	127,631,116円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	570,744,237円
たわらノーロード バランス（堅実型）	41,076,651円
たわらノーロード バランス（標準型）	106,018,353円
たわらノーロード バランス（積極型）	42,143,691円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	433,638円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,362,316円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,418,021円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	708,921円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	970,378円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	44,240,071円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	196,333,833円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	205,234,186円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	390,060,660円
投資のソムリエ	14,730,660,998円
クルーズコントロール	561,530,700円
投資のソムリエ<DC年金>	1,365,537,152円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	171,006,640円
クルーズコントロール<DC年金>	555,422円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	2,689,571円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	8,028,155円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	480,601,368円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,441,445,854円
ワールドアセットバランス（基本コース）	843,793,149円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	661,346,596円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	13,619,101円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,572,784円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,570,407円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	26,427,979円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,216,906,979円 152,088,521円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	3,742,506円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,644,812円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,706,562円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	15,503,078,087円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,619,219,446円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)	367,691,412円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	74,578,342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)	188,477,470円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	133,467,915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)	5,865,056,518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)	3,787,321,725円
計	55,964,742,243円
2. 受益権の総数	55,964,742,243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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	5,502,015,020
合計	5,502,015,020

(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(令和2年4月21日から令和2年7月13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	令和2年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	410,000,000	-	410,011,513	11,513
	410,000,000	-	410,011,513	11,513
合計	410,000,000	-	410,011,513	11,513

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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)

	令和2年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0436円 (20,436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

令和2年7月13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	BRAZIL 2.625 01/05/23	7,800,000.000	7,995,000.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	12,100,000.000	12,838,886.500	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	8,309,600.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	10,800,000.000	11,422,998.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	6,000,000.000	5,628,750.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	9,800,000.000	9,464,791.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,100,000.000	8,505,000.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	10,600,000.000	11,053,627.000	

BRAZIL 6.0 04/07/26	10,800,000.000	12,326,850.000	
BRAZIL 7.125 01/20/37	8,300,000.000	9,995,648.500	
BRAZIL 8.25 01/20/34	6,200,000.000	8,080,460.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	5,800,000.000	7,091,080.000	
COLOMBIA 2.625 03/15/23	4,700,000.000	4,775,928.500	
COLOMBIA 3.875 04/25/27	9,600,000.000	10,210,272.000	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	7,100,000.000	7,466,182.500	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,000,000.000	6,546,630.000	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	7,000,000.000	7,705,530.000	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	14,000,000.000	16,006,130.000	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	8,311,100.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	8,000,000.000	9,674,360.000	
COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,000,000.000	11,295,000.000	
COLOMBIA 7.375 09/18/37	8,400,000.000	11,562,600.000	
COLOMBIA 8.125 05/21/24	6,900,000.000	8,280,000.000	
CROATIA 5.5 04/04/23	10,400,000.000	11,490,980.800	
CROATIA 6.0 01/26/24	12,400,000.000	14,249,336.000	
HUNGARY 5.375 02/21/23	11,358,000.000	12,522,195.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	9,380,000.000	10,713,817.240	
HUNGARY 5.75 11/22/23	9,000,000.000	10,285,101.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	7,000,000.000	11,904,060.000	
INDONESIA 3.375 04/15/23	7,700,000.000	8,035,204.560	
INDONESIA 3.4 09/18/29	3,000,000.000	3,192,913.860	
INDONESIA 3.5 01/11/28	5,200,000.000	5,548,236.660	
INDONESIA 3.7 10/30/49	4,000,000.000	4,190,351.800	
INDONESIA 3.85 07/18/27	4,600,000.000	4,985,480.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	4,000,000.000	4,444,565.360	
INDONESIA 4.125 01/15/25	8,800,000.000	9,584,809.340	
INDONESIA 4.35 01/08/27	6,000,000.000	6,700,991.400	
INDONESIA 4.35 01/11/48	4,000,000.000	4,565,327.920	
INDONESIA 4.625 04/15/43	3,400,000.000	3,946,331.070	
INDONESIA 4.75 01/08/26	8,800,000.000	9,977,287.840	
INDONESIA 4.75 02/11/29	5,000,000.000	5,819,916.450	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,400,000.000	6,743,569.410	
INDONESIA 5.25 01/08/47	6,400,000.000	8,128,056.960	
INDONESIA 5.25 01/17/42	8,300,000.000	10,403,031.830	
INDONESIA 5.35 02/11/49	4,000,000.000	5,212,862.160	
INDONESIA 5.875 01/15/24	8,200,000.000	9,318,340.430	
INDONESIA 5.95 01/08/46	5,200,000.000	7,175,916.690	
INDONESIA 6.75 01/15/44	9,500,000.000	14,040,882.290	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,500,000.000	9,888,580.650	
PANAMA 3.16 01/23/30	5,000,000.000	5,420,000.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,200,000.000	5,676,554.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	5,100,000.000	5,787,760.500	
PANAMA 4.5 04/16/50	7,300,000.000	9,143,250.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	5,000,000.000	6,233,975.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	7,900,000.000	11,498,450.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	6,800,000.000	8,643,276.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	7,519,344.000	

PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,411,200.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,300,000.000	6,127,118.000	
PERU 5.625 11/18/50	10,000,000.000	16,042,950.000	
PERU 6.55 03/14/37	7,000,000.000	10,747,800.000	
PERU 7.35 07/21/25	6,300,000.000	8,036,280.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	8,000,000.000	8,691,920.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,000,000.000	6,927,111.840	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	7,000,000.000	8,031,173.080	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	6,000,000.000	6,889,265.280	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	7,974,477.980	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	7,800,000.000	8,529,749.740	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	5,800,000.000	7,510,198.780	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	5,600,000.000	6,748,197.230	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	5,007,413.120	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,000,000.000	8,679,141.300	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	6,100,000.000	9,157,431.630	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,800,000.000	11,102,336.400	
ROMANIA 4.375 08/22/23	9,000,000.000	9,610,389.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	6,600,000.000	7,230,960.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	5,423,837.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	7,400,000.000	9,669,202.600	
ROMANIA 6.75 02/07/22	8,500,000.000	9,174,560.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	9,853,000.000	11,335,876.500	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	10,400,000.000	11,648,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	12,400,000.000	14,179,424.800	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	7,800,000.000	8,257,602.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	11,400,000.000	13,070,977.800	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	12,400,000.000	13,802,849.200	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	15,000,000.000	18,635,460.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	23,000,000.000	30,995,605.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	10,000,000.000	13,732,930.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	7,200,000.000	10,253,793.600	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	8,200,000.000	7,594,167.600	

SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	8,000,000.000	7,602,720.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	7,400,000.000	7,418,870.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	5,200,000.000	4,561,346.400	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	10,000,000.000	8,775,000.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	6,000,000.000	6,339,720.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	6,400,000.000	6,523,456.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	7,200,000.000	7,648,272.000	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	3,775,400.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	9,820,264.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	6,900,000.000	7,193,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	8,200,000.000	8,617,749.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	9,500,000.000	10,142,152.500	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	9,000,000.000	9,835,290.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	10,400,000.000	11,236,004.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	5,000,000.000	5,059,175.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	10,000,000.000	10,361,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	12,000,000.000	13,144,500.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	9,000,000.000	9,421,155.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	8,400,000.000	8,780,478.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	15,400,000.000	16,467,143.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	9,400,000.000	11,221,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,800,000.000	11,076,891.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	9,900,000.000	12,219,619.500	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	8,200,000.000	10,715,760.000	
アメリカ・ドル 小計	894,091,000.000 (95,524,682,440)	1,041,723,045.700 (111,297,690,202)	

国債証券 合計	95,524,682,440 (95,524,682,440)	111,297,690,202 (111,297,690,202)	
合計		111,297,690,202 (111,297,690,202)	

(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 114銘柄	97.32	100.00

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,827,347,856
コール・ローン	84,270,876
株式	35,799,091,148
新株予約権証券	31,307
投資信託受益証券	192,401,264
投資証券	33,836,919
派生商品評価勘定	304,715,693
未収入金	12,037,146
未収配当金	181,077,738
差入委託証拠金	2,250,602,553
流動資産合計	41,685,412,500
資産合計	41,685,412,500
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,788
未払解約金	12,859,800
流動負債合計	12,870,588
負債合計	12,870,588
純資産の部	
元本等	
元本	36,240,000,306
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,432,541,606
元本等合計	41,672,541,912
純資産合計	41,672,541,912
負債純資産合計	41,685,412,500

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年1月15日 至 令和2年7月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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>新株予約権証券</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>先物取引</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、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</p> <p>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、計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	令和2年7月13日現在
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	47,688,669,927円
同期中追加設定元本額	28,061,930,736円
同期中一部解約元本額	39,510,600,357円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	6,448,966,717円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし> (ファン ドラップ)	263,886,470円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,795,138円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	8,052,307円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	8,212,717円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,832,352円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	31,692,864円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,781,386円
たわらノーロード 新興国株式	6,419,264,181円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	3,185,311,297円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,072,684,712円
たわらノーロード バランス(堅実型)	9,259,236円
たわらノーロード バランス(標準型)	31,900,117円
たわらノーロード バランス(積極型)	53,539,247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)	511,527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)	77,048,057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)	151,975,746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)	131,767,256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)	182,785,076円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	330,930円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	812,932円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,011,763円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,847,564円
たわらノーロード 全世界株式	32,872,787円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	35,472,341円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	452,026,003円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	388,190,255円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	408,461,199円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	754,129,906円
投資のソムリエ	6,164,734,624円
クルーズコントロール	939,516,363円
投資のソムリエ< D C 年金>	570,890,325円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	363,111,843円
クルーズコントロール< D C 年金>	1,117,689円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	13,566,169円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	40,883,143円
投資のソムリエ< D C 年金> リスク抑制型	281,072,361円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,663,010,754円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,464,721,356円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,303,884,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,569,668円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,218,720円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	2,693,815円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	14,730,647円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,154,011,753円
9資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	286,033,290円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,080,141円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	915,177円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	906,744円
エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用)	146,441,437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)	360,144,910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)	254,322,306円
計	36,240,000,306円
2. 受益権の総数	36,240,000,306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 令和2年1月15日 至 令和2年7月13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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,442,032,366
新株予約権証券	40,990
投資信託受益証券	9,642,203
投資証券	217,819
合計	4,451,851,398

(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(令和2年4月21日から令和2年7月13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	令和2年7月13日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	384,149,892	-	384,160,680	10,788	
	384,149,892	-	384,160,680	10,788	
合計	384,149,892	-	384,160,680	10,788	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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	令和2年7月13日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	4,945,397,099	-	5,250,112,792	304,715,693	
合計	4,945,397,099	-	5,250,112,792	304,715,693	

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 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)

令和2年7月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1499円 (11,499円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年7月13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	TRIP.COM GROUP LTD ADR	26,633	26.800	713,764.400	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	11,567	9.360	108,267.120	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	4.980	120,565.800	
	CREDICORP LTD	3,955	128.740	509,166.700	
	SINA CORP	3,176	40.400	128,310.400	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	25,791	8.870	228,766.170	
	NETEASE INC-ADR	4,496	484.460	2,178,132.160	
	SOUTHERN COPPER CORP	4,220	41.660	175,805.200	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	3,789	9.530	36,109.170	
	YPF SA ADR	4,248	6.300	26,762.400	
	LUKOIL SPON ADR	23,117	71.600	1,655,177.200	
	GAZPROM PAO ADR	324,951	5.622	1,826,874.520	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	75,170	4.035	303,310.950	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	70,100	0.770	53,977.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	54,736	0.891	48,769.770	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	38,484	5.375	206,851.500	
	51JOB INC ADR	1,365	73.450	100,259.250	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	6,803	35.200	239,465.600	
	NOVATEK PJSC GDR	5,258	147.600	776,080.800	
	BAIDU INC -SPON ADR	15,168	132.330	2,007,181.440	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	7,720	19.160	147,915.200	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	35,926	26.050	935,872.300	
	ROSNEFT OIL CO GDR	70,311	5.078	357,039.250	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	7,899	148.390	1,172,132.610	
SEVERSTAL GDR	13,548	12.310	166,775.880		
TATNEFT ADR	13,758	47.500	653,505.000		
MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	17,236	7.110	122,547.960		
VTB BANK OJSC GDR	152,000	0.942	143,184.000		

MAGNIT PJSC GDR	18,769	13.710	257,322.990	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	24,908	21.850	544,239.800	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	21,099	73.560	1,552,042.440	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,630	34.640	56,463.200	
SBERBANK ADR	150,108	11.915	1,788,536.820	
PHOSAGRO PJSC GDR	8,886	12.000	106,632.000	
HUAZHU GROUP LTD ADR	6,517	36.550	238,196.350	
JOYY INC-ADR	2,845	83.700	238,126.500	
GDS HOLDINGS LTD ADR	4,666	85.610	399,456.260	
ZAI LAB LTD ADR	2,527	86.970	219,773.190	
BEST INC ADR	10,426	4.480	46,708.480	
HUYA INC ADR	1,905	24.400	46,482.000	
BILIBILI INC ADR	4,763	47.550	226,480.650	
NIO INC ADR	51,065	14.980	764,953.700	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	21,755	17.090	371,792.950	
58.COM INC ADR	4,679	54.810	256,455.990	
AUTOHOME INC ADR	2,901	89.620	259,987.620	
GSX TECHEDU INC ADR	3,754	87.630	328,963.020	
WEIBO CORP ADR	2,844	37.390	106,337.160	
JD.COM INC ADR	46,345	65.610	3,040,695.450	
GLOBANT SA	2,197	164.950	362,395.150	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	101,997	261.010	26,622,236.970	
MOMO INC SPON ADR	7,546	20.920	157,862.320	
BAOZUN INC-SPN ADR	2,070	44.570	92,259.900	
PINDUODUO INC ADR	14,218	87.300	1,241,231.400	
YUM CHINA HOLDINGS INC	19,785	51.390	1,016,751.150	
IQIYI INC ADR	10,847	22.990	249,372.530	
POLYUS PJSC GDR	3,541	92.850	328,781.850	
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	3,497	28.460	99,524.620	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	21,122	37.120	784,048.640	
アメリカ・ドル 小計	1,624,847		56,946,680.850 (6,084,183,382)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム				
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	128,376	3.900	500,666.400	
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	103,977	16.700	1,736,415.900	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	139,021	5.110	710,397.310	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	155,621	11.120	1,730,505.520	
EMAAR PROPERTIES PJSC	188,054	2.720	511,506.880	
ALDAR PROPERTIES PJSC	208,329	1.800	374,992.200	

	EMIRATES NBD BANK PJSC	61,391	8.880	545,152.080	
	EMAAR MALLS PJSC	95,355	1.460	139,218.300	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,080,124		6,248,854.590 (182,091,623)	
イギリス・ポ ンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	12,538	15.990	200,482.620	
イギリス・ポンド 小計		12,538		200,482.620 (27,063,149)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	155,439	1,878.050	291,922,213.950	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	34,000	376.350	12,795,900.000	
	ASIAN PAINTS LTD	14,169	1,703.500	24,136,891.500	
	EICHER MOTORS LTD	646	19,447.850	12,563,311.100	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	21,890	611.450	13,384,640.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	37,186	554.850	20,632,652.100	
	SHREE CEMENT LTD	424	22,295.400	9,453,249.600	
	ICICI BANK LTD	268,742	360.350	96,841,179.700	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	34,110	209.900	7,159,689.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	94,552	195.600	18,494,371.200	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	19,628	430.150	8,442,984.200	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	19,809	275.850	5,464,312.650	
	TATA STEEL LTD	21,454	338.700	7,266,469.800	
	TATA MOTORS LTD	80,886	107.600	8,703,333.600	
	JSW STEEL LTD	58,967	193.300	11,398,321.100	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	25,126	430.100	10,806,692.600	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,706	3,726.650	10,084,314.900	
	NESTLE INDIA LTD	1,190	16,833.100	20,031,389.000	
	GAIL INDIA LTD	80,283	102.400	8,220,979.200	
	VEDANTA LTD	93,682	110.350	10,337,808.700	
	AXIS BANK LTD	121,706	439.600	53,501,957.600	
	TITAN COMPANY LTD	16,558	961.850	15,926,312.300	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	118,925	78.550	9,341,558.750	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	2,118	1,392.200	2,948,679.600	
	LUPIN LTD	10,800	861.100	9,299,880.000	
	BAJAJ FINANCE LTD	9,378	3,314.150	31,080,098.700	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	90,553	1,886.000	170,782,958.000	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	41,982	170.100	7,141,138.200	
	INFOSYS LTD	186,657	781.850	145,937,775.450	
	WIPRO LTD	58,595	222.100	13,013,949.500	
INDIAN OIL CORP LTD	102,155	86.150	8,800,653.250		
HINDUSTAN UNILEVER LTD	45,057	2,223.800	100,197,756.600		

HCL TECHNOLOGIES LTD	62,666	582.250	36,487,278.500	
DABUR INDIA LTD	28,372	474.150	13,452,583.800	
HERO MOTOCORP LTD	5,174	2,681.250	13,872,787.500	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	5,584	3,905.450	21,808,032.800	
BHARTI AIRTEL LTD	137,278	574.700	78,893,666.600	
UNITED SPIRITS LTD	17,515	636.100	11,141,291.500	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	40,724	493.900	20,113,583.600	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,901	2,203.100	8,594,293.100	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	7,007	5,955.650	41,731,239.550	
AUROBINDO PHARMA LTD	14,800	820.750	12,147,100.000	
HAVELLS INDIA LTD	18,135	580.250	10,522,833.750	
INDRAPRASTHA GAS LTD	11,528	407.750	4,700,542.000	
BIOCON LTD	15,880	414.300	6,579,084.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	42,676	96.200	4,105,431.200	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	3,777	698.900	2,639,745.300	
PETRONET LNG LTD	45,012	261.600	11,775,139.200	
CIPLA LTD/INDIA	16,694	638.900	10,665,796.600	
LARSEN & TOUBRO LTD	24,834	932.150	23,149,013.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	5,870	3,798.500	22,297,195.000	
BOSCH LTD	216	13,332.150	2,879,744.400	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	49,238	2,222.350	109,424,069.300	
NTPC LTD	122,391	90.400	11,064,146.400	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,024	1,448.850	7,279,022.400	
AMBUJA CEMENTS LTD	33,121	197.200	6,531,461.200	
BHARAT FORGE LTD	7,644	354.500	2,709,798.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	63,356	163.700	10,371,377.200	
ITC LTD	204,281	194.350	39,702,012.350	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,201	1,382.850	8,575,052.850	
UNITED PHOSPHORUS LTD	23,619	436.500	10,309,693.500	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,753	2,353.000	6,477,809.000	
SIEMENS INDIA LTD	2,678	1,137.850	3,047,162.300	
INFO EDGE INDIA LTD	4,281	2,872.400	12,296,744.400	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	20,942	697.250	14,601,809.500	
TECH MAHINDRA LTD	24,889	569.000	14,161,841.000	
MARICO LTD	32,031	343.600	11,005,851.600	
PAGE INDUSTRIES LTD	191	19,892.750	3,799,515.250	
DLF LTD	24,013	147.750	3,547,920.750	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	100,804	172.600	17,398,770.400	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	35,242	334.950	11,804,307.900	
REC LTD	43,697	104.750	4,577,260.750	

	BAJAJ FINSERV LTD	1,866	6,483.800	12,098,770.800	
	BAJAJ AUTO LTD	4,391	2,894.700	12,710,627.700	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	4,605	1,620.600	7,462,863.000	
	COAL INDIA LTD	59,037	131.200	7,745,654.400	
	BHARTI INFRATEL LTD	14,070	209.050	2,941,333.500	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	39.050	91,103.650	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	35,160	592.500	20,832,300.000	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,316	2,458.650	3,235,583.400	
	BANDHAN BANK LTD	12,358	373.950	4,621,274.100	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	16,720	498.550	8,335,756.000	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	9,035	2,322.700	20,985,594.500	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	10,523	1,260.100	13,260,032.300	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	24,802	417.450	10,353,594.900	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	3,635	1,016.750	3,695,886.250	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	20,055	860.200	17,251,311.000	
インド・ルピー	小計	3,403,318		1,987,977,115.400 (2,842,807,275)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	1,297,300	1,220.000	1,582,706,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	105,001	17,925.000	1,882,142,925.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	300,100	6,500.000	1,950,650,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	405,500	7,925.000	3,213,587,500.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,063,700	4,830.000	5,137,671,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	2,833,900	3,110.000	8,813,429,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	348,800	6,000.000	2,092,800,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	14,400	46,875.000	675,000,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	456,300	1,650.000	752,895,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	54,900	11,600.000	636,840,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	142,800	7,775.000	1,110,270,000.000	
	BANK MANDIRI	998,000	5,175.000	5,164,650,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,135,500	3,110.000	9,751,405,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	822,200	1,135.000	933,197,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	330,700	4,670.000	1,544,369,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,420,400	1,470.000	2,087,988,000.000	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	208,300	9,425.000	1,963,227,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	539,000	31,000.000	16,709,000,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	35,500	2,860.000	101,530,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,085.000	1,013,498,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	9,225.000	1,522,125,000.000	
	ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	184,400	1,555.000	286,742,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	15,795,801		68,925,723,425.000 (516,942,926)	
オフショア・ 人民元	CENTRE TESTING INTERNATIONAL GROUP CO LTD	10,100	23.510	237,451.000	
	EVE ENERGY CO LTD	9,032	56.670	511,843.440	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	27.240	147,096.000	
	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	5,800	35.120	203,696.000	
	BEIJING THUNISOFT CORP LTD	6,400	29.390	188,096.000	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	64.050	192,150.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	17.280	207,360.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	3,500	64.190	224,665.000	
	UNISPLENDOUR CORP LTD	5,600	50.260	281,456.000	
	WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	12.120	197,556.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	10.290	196,539.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	56.560	226,240.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	106.310	127,572.000	
	JOYOUNG CO LTD	5,100	35.300	180,030.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	25.830	193,725.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	1,600	455.000	728,000.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,530	24.500	257,985.000	
	YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	26.550	175,230.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,200	72.850	378,820.000	

SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	28.050	165,495.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	2,000	32.100	64,200.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	6.100	145,180.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	24.200	159,720.000	
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	2,100	47.890	100,569.000	
GEM CO LTD	29,100	5.310	154,521.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	57.990	400,131.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	15,500	17.120	265,360.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	6,120	35.680	218,361.600	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	35.000	206,640.000	
ZHEJIANG NHU CO LTD	3,800	30.370	115,406.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	1,900	35.890	68,191.000	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	1,800	43.360	78,048.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	28.860	190,476.000	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD	3,900	47.880	186,732.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	53.460	181,764.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	2,100	24.700	51,870.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	26.970	40,455.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	1,700	30.600	52,020.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	3,700	52.020	192,474.000	
ZHEJIANG WANFENG AUTO WHEEL CO LTD	27,000	6.910	186,570.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	22.650	190,260.000	
VENUSTECH GROUP INC	1,000	45.400	45,400.000	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONMENT CO LTD	40,700	4.930	200,651.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	11,700	89.410	1,046,097.000	

CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,700	111.790	413,623.000	
GLODON CO LTD	2,300	75.050	172,615.000	
WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC	6,800	24.100	163,880.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	18.180	185,436.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	16.690	186,928.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	5.960	187,144.000	
NAVINFO CO LTD	1,100	20.940	23,034.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	9.270	132,561.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	26.310	71,826.300	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	22.910	59,566.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	48.640	379,392.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	9,600	15.900	152,640.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	31.040	186,240.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	700	129.000	90,300.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	45.030	160,757.100	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	18.700	278,630.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	14.760	187,452.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	20.720	178,192.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	50,000	3.620	181,000.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	11,180	45.930	513,497.400	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	1,900	28.290	53,751.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	9,800	35.030	343,294.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	44.880	309,672.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.330	241,806.000	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,300	48.900	63,570.000	

DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	36.050	176,645.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	13.930	213,129.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	7.280	152,880.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	28.780	215,850.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	32.060	160,300.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	48.990	323,334.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	6,700	121.500	814,050.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	7,400	48.600	359,640.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	9.770	146,061.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	11.440	202,488.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	3,700	25.840	95,608.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	18.930	112,444.200	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,800	39.710	150,898.000	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	9.340	149,440.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	172.180	361,578.000	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD	60,100	3.900	234,390.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	5.700	207,936.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	14.360	205,348.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	22,554	56.170	1,266,858.180	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	9.190	252,725.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	23,200	6.020	139,664.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	11,100	31.990	355,089.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	6,500	21.500	139,750.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	14.140	53,732.000	
IFLYTEK CO LTD	7,500	41.130	308,475.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.280	238,716.000	

GOERTEK INC	10,500	32.310	339,255.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	11.350	241,755.000	
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	1,800	9.370	16,866.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	20,900	30.680	641,212.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	4,300	34.900	150,070.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	6.610	313,314.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	9.210	260,643.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	8.110	304,936.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	12,200	13.020	158,844.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	10.690	242,663.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	7,900	49.160	388,364.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,800	107.310	300,468.000	
AVIC AIRCRAFT CO LTD	10,700	22.930	245,351.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	24,240	25.630	621,271.200	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	6,400	134.050	857,920.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	13,400	207.000	2,773,800.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	10.140	210,912.000	
SUNING.COM CO LTD	29,100	11.240	327,084.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	120,000	5.080	609,600.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	13,000	19.850	258,050.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	9,500	58.990	560,405.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	29,700	36.960	1,097,712.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	14.450	245,650.000	
PING AN BANK CO LTD	63,100	14.860	937,666.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	30,280	24.290	735,501.200	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	65,700	6.170	405,369.000	
CHINA VANKE CO LTD	39,600	29.170	1,155,132.000	

ZTE CORP	17,500	44.940	786,450.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.720	220,020.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	22,000	15.330	337,260.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	48.550	203,910.000	
GF SECURITIES CO LTD	18,300	17.650	322,995.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.120	234,632.000	
BYD CO LTD	9,800	89.000	872,200.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	8,600	12.600	108,360.000	
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	11,000	21.530	236,830.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	23.810	307,149.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	53.360	154,744.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	24.230	193,840.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,200	221.300	265,560.000	
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	19.050	68,580.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	49,400	4.250	209,950.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	3,700	59.980	221,926.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	180.740	216,888.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	10.200	159,120.000	
GUOCHENG MINING CO LTD	7,900	20.890	165,031.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	28.300	186,780.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	76.730	46,038.000	
NINESTAR CORP	5,700	36.580	208,506.000	
SANSTEEL MINGUANG CO LTD FUJIAN	24,100	7.720	186,052.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	25.860	181,537.200	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.190	107,822.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	21.450	257,400.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	4,200	51.500	216,300.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	156.200	249,920.000	

ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	233.640	116,820.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	15.910	240,241.000	
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	29.200	154,760.000	
SF HOLDING CO LTD	8,100	64.850	525,285.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	11.300	266,680.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	37.130	241,345.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	22,590	8.710	196,758.900	
CSC FINANCIAL CO LTD	6,300	50.500	318,150.000	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	5,000	56.720	283,600.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,100	118.950	249,795.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	17,100	15.620	267,102.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	73.100	226,610.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	40.450	210,340.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	74.450	234,517.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	74.100	244,530.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	106.500	287,550.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	69.750	216,225.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	1,500	120.400	180,600.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	8.050	189,980.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	43.960	189,907.200	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	17.290	164,255.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	69.390	208,170.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	23.990	187,122.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	188.050	157,962.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO- PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	62.980	170,046.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	1,600	103.360	165,376.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	74.090	98,539.700	

BGI GENOMICS CO LTD	1,300	196.000	254,800.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	66.970	200,910.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	1,600	189.270	302,832.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	13.790	175,133.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	9.530	257,310.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	88.430	168,017.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	17.610	172,578.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	16.030	230,832.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	3,100	318.670	987,877.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	29.710	157,463.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	14.050	217,775.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,100	237.100	260,810.000	
OVCTEK CHINA INC	2,900	65.320	189,428.000	
SG MICRO CORP	600	337.020	202,212.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	6,200	203.900	1,264,180.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	840	273.800	229,992.000	
WUXI APPTec CO LTD	9,160	101.310	927,999.600	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	2,500	160.030	400,075.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	1,400	244.000	341,600.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	2.310	188,727.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	173.250	155,925.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.600	510,140.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	5.220	1,105,596.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	3.360	921,984.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.670	308,280.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.130	173,873.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	40.900	409,000.000	

CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	6,000	16.460	98,760.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	59,600	37.250	2,220,100.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	38,800	82.340	3,194,792.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	52,800	17.600	929,280.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	69,900	11.600	810,840.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	6.270	866,514.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	38,600	18.930	730,698.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,100	1,713.850	7,026,785.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	137,200	5.420	743,624.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	41,000	31.770	1,302,570.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	25,900	31.700	821,030.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	4.800	183,840.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	61,100	18.890	1,154,179.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	22,900	6.860	157,094.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	141,600	4.160	589,056.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	103,800	5.270	547,026.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	73,600	4.810	354,016.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	24,200	15.600	377,520.000	
HUAXIA BANK CO LTD	16,700	6.760	112,892.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	25,800	34.560	891,648.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	34,200	5.400	184,680.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	46,800	5.190	242,892.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	56,900	5.250	298,725.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	19,100	57.180	1,092,138.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	15,700	28.590	448,863.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	39,700	17.440	692,368.000	
CRRG CORP LTD	36,400	6.180	224,952.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	14,860	99.350	1,476,341.000	

CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	3,300	12.640	41,712.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	29,800	9.380	279,524.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	37,000	22.960	849,520.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	21,000	8.440	177,240.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	131,400	5.780	759,492.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	7,100	55.880	396,748.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	34,200	17.970	614,574.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	37,200	20.440	760,368.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	61,800	1.970	121,746.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	18,100	6.550	118,555.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	3,200	35.540	113,728.000	
GEMDALE CORP	10,600	15.260	161,756.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	6,500	28.280	183,820.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	13,500	53.790	726,165.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	12,870	20.240	260,488.800	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	70,000	5.660	396,200.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	15,900	8.960	142,464.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	8.300	262,280.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	14,500	22.000	319,000.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.000	149,000.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	6,300	203.490	1,281,987.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	173,900	1.220	212,158.000	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LTD	66,900	4.270	285,663.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	32,200	5.000	161,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	65,800	3.370	221,746.000	
AIR CHINA LTD	28,400	7.310	207,604.000	
TBEA CO LTD	26,700	7.320	195,444.000	

CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	31,400	6.210	194,994.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	33,600	2.910	97,776.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	26,400	4.460	117,744.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	75.550	249,315.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	35.310	243,639.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	6.000	205,800.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,400	23.170	194,628.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	15.660	231,768.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	13.810	66,288.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	9.680	229,416.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	2,100	19.630	41,223.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	32.200	299,460.000	
BANK OF NANJING CO LTD	15,600	8.100	126,360.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	19.280	146,528.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	61,800	4.290	265,122.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	9.930	280,026.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	3,600	28.200	101,520.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	6,800	39.300	267,240.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	26.660	202,616.000	
BBMG CORP	54,200	3.300	178,860.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	10.010	294,294.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	9.620	178,932.000	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO LTD	12,500	13.800	172,500.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	9.990	150,039.810	
AISINO CORP	10,300	19.220	197,966.000	

SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	40,000	6.600	264,000.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	2,340	117.100	274,014.000	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	8,450	52.080	440,076.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	5.620	183,774.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.320	195,880.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.700	183,330.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.780	173,568.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	52.000	239,200.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	10.920	183,456.000	
INNER MONGOLIA MENGDIAN HUANENG THERMAL POWER CORP LTD	63,000	2.680	168,840.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	7.240	141,904.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,700	182.460	310,182.000	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	16.860	151,740.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	26,600	7.180	190,988.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	4,400	154.400	679,360.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	32.860	39,432.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	26,300	6.870	180,681.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	11.870	296,750.000	
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	25,900	7.210	186,739.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	7.600	171,760.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	4,500	46.580	209,610.000	
MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD	72,400	2.860	207,064.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	12,900	7.930	102,297.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	13.300	167,580.000	

COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	7.360	220,800.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	63.000	264,600.000	
INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD	19,900	11.550	229,845.000	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD	6,400	28.030	179,392.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	36.950	215,418.500	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,900	16.570	197,183.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	16.700	197,060.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	33.100	148,950.000	
TONGWEI CO LTD	11,600	19.780	229,448.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,100	72.010	79,211.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	70.290	175,725.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	34.400	182,320.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	25.320	141,792.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	9,300	20.420	189,906.000	
CHINA JUSHI CO LTD	23,400	9.790	229,086.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	1,924	57.990	111,572.760	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	6,700	18.530	124,151.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.490	227,493.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	84.920	144,364.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	55.050	269,745.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	18,000	46.210	831,780.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	129.920	233,856.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,800	27.030	183,804.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	7.870	254,602.370	

FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	6,580	130.240	856,979.200	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	45.660	228,300.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	26.570	31,884.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	40.400	234,320.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	14.700	194,040.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	12,800	10.050	128,640.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,100	20.620	868,102.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	4.530	270,441.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	52.850	179,690.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	8.820	145,530.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	21,800	6.360	138,648.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	9.800	231,280.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	9,000	21.010	189,090.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,100	160.000	176,000.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	29.330	58,660.000	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	259.470	311,364.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	6,500	17.340	112,710.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	500	159.500	79,750.000	
TOLY BREAD CO LTD	3,600	52.680	189,648.000	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,200	86.120	189,464.000	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	82.000	241,080.000	
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	22,700	12.670	287,609.000	
SPRING AIRLINES CO LTD	1,000	39.340	39,340.000	
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	28.270	452,320.000	
DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD	4,100	50.490	207,009.000	
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	1,400	59.170	82,838.000	
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	9.060	264,552.000	
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	3,700	36.930	136,641.000	
オフショア・人民元 小計	7,206,824		118,586,686.660	

(1,808,446,972)

カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	211,930	18.200	3,857,126.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	63,184	3.745	236,624.080	
	OOREDOO QSC	22,936	6.714	153,992.300	
	QATAR FUEL QSC	25,661	16.200	415,708.200	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	26,129	16.570	432,957.530	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	23,582	8.177	192,830.010	
	INDUSTRIES QATAR QSC	93,380	8.172	763,101.360	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	61,353	16.010	982,261.530	
	MASRAF AL RAYAN	204,697	3.939	806,301.480	
	BARWA REAL ESTATE CO	124,139	3.255	404,072.440	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	222,153	2.090	464,299.770	
カタール・リアル 小計	1,079,144		8,709,274.700 (255,355,934)		
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	22,428	19,700.000	441,831,600.000	
	ECOPETROL SA	267,551	2,080.000	556,506,080.000	
	BANCOLOMBIA SA	13,029	24,980.000	325,464,420.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	21,780	25,460.000	554,518,800.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	19,950	20,280.000	404,586,000.000	
コロンビア・ペソ 小計	344,738		2,282,906,900.000 (67,574,044)		
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	14,142	51.700	731,141.400	
	JARIR MARKETING CO	3,797	150.000	569,550.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,937	78.600	152,248.200	
	ETIHAD ETISALAT CO	25,727	27.700	712,637.900	
	SAUDI BRITISH BANK	44,501	23.460	1,043,993.460	
	AL RAJHI BANK	64,938	57.900	3,759,910.200	
	ARAB NATIONAL BANK	30,086	19.260	579,456.360	
	BANK ALBILAD	25,739	23.400	602,292.600	
	BANK AL-JAZIRA	13,708	12.240	167,785.920	
	BANQUE SAUDI FRANSI	28,582	29.650	847,456.300	
	RIYAD BANK	64,803	17.300	1,121,091.900	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	57,152	26.800	1,531,673.600	
	SAUDI TELECOM CO	33,042	97.500	3,221,595.000	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	10,621	77.300	821,003.300	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	48,835	88.200	4,307,247.000	
SAUDI CEMENT CO	2,773	54.200	150,296.600		
SAUDI ELECTRICITY CO	44,630	15.540	693,550.200		

	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	6,825	19.460	132,814.500	
	SAVOLA GROUP	13,879	46.650	647,455.350	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	10,231	10.980	112,336.380	
	ALMARAI CO JSC	13,893	54.300	754,389.900	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	7.190	203,556.090	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	28,905	14.980	432,996.900	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	3,548	52.100	184,850.800	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	61,393	8.410	516,315.130	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	29,487	7.420	218,793.540	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	6,066	13.600	82,497.600	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	3,723	113.200	421,443.600	
	ALINMA BANK	49,980	14.740	736,705.200	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	2,636	116.800	307,884.800	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	27,317	35.700	975,216.900	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,042	82.200	85,652.400	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	62,177	33.450	2,079,820.650	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	81,379	37.000	3,011,023.000	
	サウジアラビア・リアル 小計	945,805		31,916,682.680 (910,582,957)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	37,300	107.500	4,009,750.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	64,600	39.750	2,567,850.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	146,200	10.400	1,520,480.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	40,800	62.500	2,550,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	42,300	72.250	3,056,175.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	585,955	3.500	2,050,842.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	44,200	91.500	4,044,300.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,336,200	1.040	1,389,648.000	
	IRPC PCL NVDR	314,700	2.740	862,278.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	14,600	253.000	3,693,800.000	
	SHIN CORP PCL	126,100	57.000	7,187,700.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	182,200	31.750	5,784,850.000	

ADVANCED INFO SERVICE PCL	59,400	189.500	11,256,300.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	355,220	15.900	5,647,998.000	
PTT PCL	637,500	38.250	24,384,375.000	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	146,400	13.700	2,005,680.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	65,600	30.500	2,000,800.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	645,800	7.700	4,972,660.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	46,250	383.000	17,713,750.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	218,300	55.000	12,006,500.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	64,000	91.500	5,856,000.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	126,200	49.500	6,246,900.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	497,300	22.800	11,338,440.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	120.500	3,651,150.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	136,010	19.400	2,638,594.000	
THAI OIL PCL NVDR	59,100	42.750	2,526,525.000	
CP ALL PCL NVDR	322,100	65.750	21,178,075.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	464,300	11.200	5,200,160.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	68,245	91.000	6,210,295.000	
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	20,000	39.000	780,000.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	123,422	27.250	3,363,249.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	126,408	46.000	5,814,768.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	101,800	45.750	4,657,350.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	348,400	9.450	3,292,380.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	24,700	53.000	1,309,100.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	85,300	37.750	3,220,075.000	
OSOTSPA PCL NVDR	26,700	39.250	1,047,975.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	24.200	2,548,260.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	455,600	4.000	1,822,400.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	89,333	32.000	2,858,656.000	

	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	21,200	50.750	1,075,900.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	30,700	53.500	1,642,450.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	73.500	3,608,850.000	
タイ・パーツ 小計		8,485,143		220,593,289.000 (752,223,115)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,964	568.000	2,819,552.000	
	CEZ	8,611	480.000	4,133,280.000	
	MONETA MONEY BANK AS	42,909	54.300	2,329,958.700	
チェコ・コルナ 小計		56,484		9,282,790.700 (42,143,870)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,458,785	33.900	117,252,811.500	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,734	27,500.000	102,685,000.000	
	BANCO DE CHILE	2,432,000	73.940	179,822,080.000	
	EMPRESAS CMPC SA	58,710	1,640.000	96,284,400.000	
	EMPRESAS COPEC SA	18,031	6,050.000	109,087,550.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	4,546	5,840.000	26,548,640.000	
	ENTEL CHILE SA	6,610	5,455.000	36,057,550.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,730,165	123.180	213,121,724.700	
	COLBUN SA	255,043	135.000	34,430,805.000	
	AGUAS ANDINAS SA	263,023	290.000	76,276,670.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	20,026	2,018.200	40,416,473.200	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	5,799	21,900.000	126,998,100.000	
	FALABELLA SA	43,581	2,645.000	115,271,745.000	
	CENCOSUD SA	93,545	1,200.000	112,254,000.000	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	1,515.000	44,284,965.000	
ENEL CHILE SA	1,404,356	63.100	88,614,863.600		
チリ・ペソ 小計		9,827,185		1,519,407,378.000 (203,752,529)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	189,755	5.750	1,091,091.250	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	5,860	22.220	130,209.200	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	11,361	31.780	361,052.580	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	104,184	8.600	895,982.400	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	73.000	340,764.000	
	KOC HOLDING AS	24,647	17.140	422,449.580	
	TURK HAVA YOLLARI	44,206	11.830	522,956.980	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	51,991	16.090	836,535.190	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	106,818	7.810	834,248.580	
	TURKIYE IS BANKASI	69,478	5.270	366,149.060	

	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	9,597	85.450	820,063.650	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	239,230	2.290	547,836.700	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	28,304	9.100	257,566.400	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,617	68.150	1,609,498.550	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	17,286	17.050	294,726.300	
トルコ・リラ 小計		931,002		9,331,130.420 (145,285,701)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	6,096	6,700.000	40,843,200.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	22,160	1,834.000	40,641,440.000	
	OTP BANK NYRT	13,210	10,760.000	142,139,600.000	
ハンガリー・フォリント 小計		41,466		223,624,240.000 (76,568,940)	
パキスタン・ ルピー	MCB BANK LTD	12,400	165.080	2,046,992.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	21,868	114.510	2,504,104.680	
	HABIB BANK LTD	19,300	106.490	2,055,257.000	
パキスタン・ルピー 小計		53,568		6,606,353.680 (4,294,130)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	399,500	32.000	12,784,000.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	134,530	49.300	6,632,329.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	27,060	73.200	1,980,792.000	
	AYALA CORP	14,053	745.000	10,469,485.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,555	2,076.000	3,228,180.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	70,880	98.750	6,999,400.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	153,590	69.700	10,705,223.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	32,590	137.500	4,481,125.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	147,175	36.500	5,371,887.500	
	BDO UNIBANK INC	106,583	94.700	10,093,410.100	
	MEGAWORLD CORP	879,000	3.140	2,760,060.000	
	PLDT INC	5,550	1,360.000	7,548,000.000	
	ROBINSONS LAND CORP	94,000	15.920	1,496,480.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	490,975	31.900	15,662,102.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	44,150	123.500	5,452,525.000	
	SM INVESTMENTS CORP	11,948	940.000	11,231,120.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	3.550	3,201,745.000	
ABOITIZ POWER CORP	95,700	26.850	2,569,545.000		

	MANILA ELECTRIC COMPANY	7,320	278.000	2,034,960.000	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	67,600	47.750	3,227,900.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	450.000	2,970,450.000	
フィリピン・ペソ 小計		3,692,260		130,900,719.100 (282,745,553)	
ブラジル・レアル	BRF SA	26,892	20.600	553,975.200	
	VALE SA	200,921	56.970	11,446,469.370	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	7,900	60.520	478,108.000	
	RAIA DROGASIL SA	10,600	110.600	1,172,360.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	41,500	14.910	618,765.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	9,450	37.090	350,500.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	36.270	714,519.000	
	BANCO DO BRASIL SA	42,600	34.140	1,454,364.000	
	ITAUSA SA	259,060	10.230	2,650,183.800	
	LOJAS AMERICANAS SA	38,674	35.160	1,359,777.840	
	GERDAU SA	50,330	16.100	810,313.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	7,806	70.700	551,884.200	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	209,410	23.000	4,816,430.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	42,100	22.610	951,881.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	254,512	22.510	5,729,065.120	
	COGNA EDUCACAO	85,547	8.640	739,126.080	
	CCR SA	62,020	14.500	899,290.000	
	WEG SA	47,472	54.700	2,596,718.400	
	BANCO BRADESCO SA PREF	252,985	22.270	5,633,975.950	
	BANCO BRADESCO SA	60,525	20.450	1,237,736.250	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	19,506	11.230	219,052.380	
	SUZANO SA	26,575	36.680	974,771.000	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	30.340	512,746.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	269,347	27.200	7,326,238.400	
	PORTO SEGURO SA	4,600	53.360	245,456.000	
	B2W CIA DIGITAL	10,100	120.240	1,214,424.000	
	BRASKEM SA	10,330	23.600	243,788.000	
	ENGIE BRASIL SA	14,887	42.940	639,247.780	
	LOCALIZA RENT A CAR	30,289	43.540	1,318,783.060	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	22,228	48.850	1,085,837.800	
LOJAS RENNER SA	42,037	44.410	1,866,863.170		
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	35,904	18.510	664,583.040		
COSAN SA	10,700	74.400	796,080.000		
EQUATORIAL ENERGIA SA	52,300	24.440	1,278,212.000		

	BR MALLS PARTICIPACOES SA	62,065	11.270	699,472.550	
	JBS SA	53,800	22.840	1,228,792.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	66,149	11.520	762,036.480	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	17,298	58.720	1,015,738.560	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	25,840	23.400	604,656.000	
	HYPERA SA	25,400	32.310	820,674.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	114,016	59.950	6,835,259.200	
	MAGAZINE LUIZA SA	41,500	80.180	3,327,470.000	
	CIELO SA	76,407	4.910	375,158.370	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	38,900	27.720	1,078,308.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	23,500	63.750	1,498,125.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	10,900	60.470	659,123.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	16,300	20.200	329,260.000	
	AMBEV SA	264,495	14.850	3,927,750.750	
	NATURA &CO HOLDING SA	44,300	42.030	1,861,929.000	
	RUMO SA	53,800	22.840	1,228,792.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	22,100	9.200	203,320.000	
	ブラジル・リアル 小計	3,252,477		89,607,390.250 (1,797,524,248)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	668	229.200	153,105.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,092	102.000	723,384.000	
	BANK PEKAO SA	8,690	55.700	484,033.000	
	ORANGE POLSKA SA	29,777	6.530	194,443.810	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	14,579	61.420	895,442.180	
	LPP SA	56	6,700.000	375,200.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,729	168.000	290,472.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,049	380.000	1,538,620.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	55,867	23.550	1,315,667.850	
	GRUPA LOTOS SA	3,978	59.460	236,531.880	
	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	82,178	4.872	400,371.210	

	CYFROWY POLSAT SA	17,679	28.020	495,365.580	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	7.148	373,068.410	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	30,735	28.750	883,631.250	
	DINO POLSKA SA	2,402	201.800	484,723.600	
ポーランド・ズロチ 小計		311,671		8,844,060.370 (239,497,155)	
マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	84,400	3.250	274,300.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,100	9.900	139,590.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	335,500	3.810	1,278,255.000	
	DIGI.COM BHD	171,200	4.340	743,008.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	68,520	5.300	363,156.000	
	RHB BANK BHD	78,280	5.090	398,445.200	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	34,400	8.990	309,256.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	74,500	21.920	1,633,040.000	
	GAMUDA BHD	69,600	3.450	240,120.000	
	GENTING BHD	165,800	4.090	678,122.000	
	YTL CORP BHD	240,210	0.800	192,168.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	8,756	13.980	122,408.880	
	HONG LEONG BANK BHD	32,908	14.520	477,824.160	
	IJM CORP BHD	173,560	1.770	307,201.200	
	IOI CORP BHD	153,313	4.500	689,908.500	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	29,800	22.580	672,884.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	4,500	32.080	144,360.000	
	MALAYAN BANKING BHD	197,775	7.900	1,562,422.500	
	MISC BHD	65,080	7.850	510,878.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	3,100	139.500	432,450.000	
	PPB GROUP BHD	39,260	18.000	706,680.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	20.820	464,286.000	
	PETRONAS GAS BHD	35,500	16.700	592,850.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	139,600	2.530	353,188.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	56,700	4.130	234,171.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	130,550	11.360	1,483,048.000	
	QL RESOURCES BHD	61,300	9.880	605,644.000	
	DIALOG GROUP BHD	208,644	3.880	809,538.720	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	168,230	18.500	3,112,255.000	
	CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD	7,000	25.080	175,560.000	
	SIME DARBY BERHAD	80,600	2.150	173,290.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	83,100	17.060	1,417,686.000	
AXIATA GROUP BERHAD	130,100	3.410	443,641.000		
MAXIS BHD	128,300	5.320	682,556.000		

	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	123,600	6.300	778,680.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	116,400	5.340	621,576.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	100,600	3.620	364,172.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	42,300	4.800	203,040.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	95,900	5.030	482,377.000	
マレーシア・リンギット 小計		3,775,286		24,874,036.160 (623,343,346)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	161,300	12.070	1,946,891.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	77,700	37.510	2,914,527.000	
	GRUMA SAB DE CV	14,110	231.860	3,271,544.600	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	7,060	161.990	1,143,649.400	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	13,400	43.530	583,302.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	150,400	79.390	11,940,256.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	62,925	32.430	2,040,657.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,555	235.700	1,780,713.500	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	79,400	34.490	2,738,506.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	9,765	237.270	2,316,941.550	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	179,552	54.660	9,814,312.320	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,863,178	14.030	26,140,387.340	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	189,200	15.600	2,951,520.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	14,300	103.400	1,478,620.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	284,100	54.880	15,591,408.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	19,440	145.550	2,829,492.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	30,200	65.340	1,973,268.000	
BECLE SAB DE CV	38,400	41.710	1,601,664.000		
メキシコ・ペソ 小計		3,201,985		93,057,660.460 (442,023,887)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,912	11.960	166,387.520	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	1,610	12.340	19,867.400	
	OPAP SA	10,575	8.690	91,896.750	
	JUMBO SA	7,156	15.790	112,993.240	

ユーロ 小計		36,383		391,144.910 (47,281,597)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	3,354	16,900.000	56,682,600.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	1,515	56,700.000	85,900,500.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,535	178,000.000	273,230,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	2,456	45,500.000	111,748,000.000	
	COWAY CO LTD	2,404	70,000.000	168,280,000.000	
	KT&G CORP	5,940	77,800.000	462,132,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,526	85,000.000	129,710,000.000	
	KOREA GAS CORP	802	25,750.000	20,651,500.000	
	CJ CORP	1,001	87,100.000	87,187,100.000	
	KAKAO CORP	3,190	355,500.000	1,134,045,000.000	
	CJ ENM CO LTD	563	125,900.000	70,881,700.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	22,350.000	55,807,950.000	
	KMW CO LTD	826	62,200.000	51,377,200.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,033	215,000.000	222,095,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	1,516	82,000.000	124,312,000.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	18,794	6,850.000	128,738,900.000	
	NCSOFT CORPORATION	934	944,000.000	881,696,000.000	
	LG UPLUS CORP	10,762	11,950.000	128,605,900.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	14,962	3,410.000	51,020,420.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	3,649	13,850.000	50,538,650.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	540	1,295,000.000	699,300,000.000	
	LG CHEM LTD	2,562	529,000.000	1,355,298,000.000	
	LG CHEM LTD	354	273,500.000	96,819,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	78	701,000.000	54,678,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	26,165	29,000.000	758,785,000.000	
	S-OIL CORP	2,412	61,700.000	148,820,400.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	7,252	22,600.000	163,895,200.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	3,000.000	60,756,000.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,386	26,700.000	143,806,200.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	683	80,500.000	54,981,500.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	859	167,500.000	143,882,500.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	1,577	68,800.000	108,497,600.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	1,959	83,700.000	163,968,300.000		

HYUNDAI MOBIS	3,746	192,500.000	721,105,000.000	
SK HYNIX INC	29,991	82,800.000	2,483,254,800.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,114	33,400.000	137,407,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	744	54,500.000	40,548,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	8,713	98,300.000	856,487,900.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,218	20,450.000	86,258,100.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	13,191	7,870.000	103,813,170.000	
KIA MOTORS CORP	12,760	32,050.000	408,958,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	435	373,500.000	162,472,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	12,678	18,700.000	237,078,600.000	
HANWHA CORP	3,446	22,650.000	78,051,900.000	
KOREAN AIR CO LTD	3,199	16,650.000	53,263,350.000	
CJ LOGISTICS	433	166,000.000	71,878,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	545	71,700.000	39,076,500.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,026	108,000.000	110,808,000.000	
HLB INC	2,124	87,000.000	184,788,000.000	
LG ELECTRONICS INC	5,396	68,200.000	368,007,200.000	
LOTTE CORP	1,591	30,250.000	48,127,750.000	
LG CORP	4,663	67,900.000	316,617,700.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	8,190.000	75,044,970.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,627	25,650.000	93,032,550.000	
NAVER CORP	6,822	299,000.000	2,039,778,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	414	58,700.000	24,301,800.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,434	42,700.000	103,931,800.000	
OTTOGI CORP	39	573,000.000	22,347,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	924	51,000.000	47,124,000.000	
KANGWON LAND INC	5,539	23,250.000	128,781,750.000	
POSCO	4,091	182,000.000	744,562,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,686	11,950.000	103,797,700.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,061	391,000.000	1,196,851,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	2,829	126,000.000	356,454,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	259,953	52,700.000	13,699,523,100.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	24,129	5,520.000	133,192,080.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	43,916	46,750.000	2,053,073,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	233	207,500.000	48,347,500.000	
YUHAN CORP	3,423	51,000.000	174,573,000.000	
HANON SYSTEMS	10,245	9,600.000	98,352,000.000	

HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	3,018	22,050.000	66,546,900.000	
GS HOLDINGS CORP	3,958	35,000.000	138,530,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	12,470	12,200.000	152,134,000.000	
CELLTRION INC	5,199	324,500.000	1,687,075,500.000	
HELIXMITH CO LTD	1,197	59,400.000	71,101,800.000	
HANA FINANCIAL GROUP	17,798	25,750.000	458,298,500.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	933	103,500.000	96,565,500.000	
CELLTRION PHARM INC	876	134,200.000	117,559,200.000	
LOTTE SHOPPING CO	550	78,600.000	43,230,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	3,786	44,900.000	169,991,400.000	
AMOREPACIFIC CORP	1,568	157,000.000	246,176,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	368	60,700.000	22,337,600.000	
SAMSUNG CARD CO	875	28,000.000	24,500,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	2,668	130,500.000	348,174,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	411	390,000.000	160,290,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	7,353	3,715.000	27,316,395.000	
LG INNOTEK CO LTD	734	177,000.000	129,918,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,009	240,500.000	483,164,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	22,356	33,950.000	758,986,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,199	23,800.000	147,536,200.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	13,609	5,030.000	68,453,270.000	
HANMI PHARM CO LTD	235	238,000.000	55,930,000.000	
FILA HOLDINGS CORP	2,424	36,400.000	88,233,600.000	
E-MART CO LTD	1,357	109,000.000	147,913,000.000	
GS RETAIL CO LTD	821	36,600.000	30,048,600.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,912	25,100.000	148,391,200.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	533	232,000.000	123,656,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	253	129,500.000	32,763,500.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,202	147,000.000	176,694,000.000	
NETMARBLE CORP	823	127,500.000	104,932,500.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	26,901	8,410.000	226,237,410.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,740	179,000.000	311,460,000.000	
SAMSUNG C&T CORP	4,825	104,500.000	504,212,500.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	931	731,000.000	680,561,000.000	
PEARL ABYSS CORP	314	220,700.000	69,299,800.000	
DOOSAN BOBCAT INC	2,922	25,500.000	74,511,000.000	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,906	106,400.000	415,598,400.000	
韓国・ウォン 小計	814,913		44,507,524,915.000 (3,961,169,717)	

香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	109,000	9.600	1,046,400.000	
	JIANGSU EXPRESS	38,000	9.140	347,320.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	58,000	3.640	211,120.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	5,700	81.690	465,633.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	335,500	54.900	18,418,950.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	61,500	55.950	3,440,925.000	
	BEIJING ENTERPRISES	23,000	27.750	638,250.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	206,000	3.180	655,080.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	206,000	22.200	4,573,200.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	6.350	444,500.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	39,500	62.650	2,474,675.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	80,000	2.830	226,400.000	
	CNOOC LTD	986,000	8.670	8,548,620.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	152,000	8.650	1,314,800.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	314,000	15.220	4,779,080.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	207,620	25.250	5,242,405.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	178,888	35.050	6,270,024.400	
	CITIC LTD	348,000	7.770	2,703,960.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	100,000	5.300	530,000.000	
	LENOVO GROUP LTD	362,000	4.870	1,762,940.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,144,000	2.760	3,157,440.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	282,742	4.610	1,303,440.620	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	84,190	15.440	1,299,893.600	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,369,200	3.410	4,668,972.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	47,000	14.500	681,500.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	139,000	19.300	2,682,700.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	44,500	90.300	4,018,350.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	184,000	5.640	1,037,760.000	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	96,000	4.210	404,160.000	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	378,000	1.520	574,560.000	

CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	74,000	9.410	696,340.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	1.930	281,780.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	73,000	14.820	1,081,860.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	61,500	13.400	824,100.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	50,000	14.420	721,000.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	147,800	25.050	3,702,390.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	36,000	23.200	835,200.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	336,000	17.600	5,913,600.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	148,000	2.680	396,640.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	52,000	38.650	2,009,800.000	
BYD CO LTD	32,500	77.300	2,512,250.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	616,000	2.320	1,429,120.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	58,000	6.810	394,980.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,000,000	1.140	1,140,000.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	236,592	4.540	1,074,127.680	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	4.620	323,400.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	409,788	6.950	2,848,026.600	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	153,000	4.500	688,500.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	97,200	9.370	910,764.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	153,000	6.350	971,550.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	407,000	19.500	7,936,500.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	263,000	4.750	1,249,250.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	144,000	19.300	2,779,200.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	188,700	41.250	7,783,875.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	90,440	16.580	1,499,495.200	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	34,000	3.970	134,980.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	233,000	1.990	463,670.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	27,000	12.480	336,960.000	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD	48,000	7.610	365,280.000	

TINGYI HOLDING CORP	98,000	12.560	1,230,880.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	22,000	61.000	1,342,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	144,000	14.440	2,079,360.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	158,000	4.300	679,400.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	81,333	45.550	3,704,718.150	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	86,000	6.150	528,900.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	385,500	15.200	5,859,600.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	157,000	34.800	5,463,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	311,700	546.500	170,344,050.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	318,500	87.900	27,996,150.000	
LI NING CO LTD	119,000	25.250	3,004,750.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	280,000	3.320	929,600.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	435,240	1.240	539,697.600	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	1.470	308,700.000	
AIR CHINA / HONG KONG	78,000	4.840	377,520.000	
ZTE CORP	44,288	26.100	1,155,916.800	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	126,000	2.470	311,220.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	169,000	13.560	2,291,640.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	289,000	2.660	768,740.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	457,205	4.700	2,148,863.500	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	102,250	4.940	505,115.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	36,000	59.800	2,152,800.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	5,180,530	6.390	33,103,586.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	47,500	93.450	4,438,875.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	144,000	5.030	724,320.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	62,000	9.820	608,840.000	
SSY GROUP LTD	50,000	5.220	261,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	119,000	8.230	979,370.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	186,000	8.560	1,592,160.000	
BANK OF CHINA LTD	4,188,200	2.810	11,768,842.000	

SHUI ON LAND LTD	486,500	1.290	627,585.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	71,000	33.800	2,399,800.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	64,800	9.290	601,992.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	216,470	39.150	8,474,800.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,236,235	4.990	16,148,812.650	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	85,000	10.220	868,700.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	56,500	8.640	488,160.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	77,600	5.200	403,520.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	281,000	4.760	1,337,560.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	51,000	17.180	876,180.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	40,100	30.150	1,209,015.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	66,000	24.300	1,603,800.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	436,142	10.560	4,605,659.520	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	87,000	3.040	264,480.000	
CHINA CITIC BANK-H	512,800	3.650	1,871,720.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	64,000	13.460	861,440.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	41,100	141.400	5,811,540.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	61,000	74.300	4,532,300.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	29.750	595,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	122,528	10.080	1,235,082.240	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	260,000	5.650	1,469,000.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	10.980	933,300.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	134,000	2.020	270,680.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	150,000	2.470	370,500.000	
SOHO CHINA LTD	111,500	3.130	348,995.000	
KINGSOFT CORP LTD	40,000	45.500	1,820,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	44,000	22.050	970,200.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	197,000	4.510	888,470.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	54,000	8.300	448,200.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	25,000	22.100	552,500.000	

CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	97,500	6.870	669,825.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	275,000	5.980	1,644,500.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	155,800	24.800	3,863,840.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	106,000	23.700	2,512,200.000	
CRRC CORP LTD - H	254,450	3.660	931,287.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	70,000	10.180	712,600.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	114,000	11.860	1,352,040.000	
SINOPHARM GROUP CO	66,800	19.720	1,317,296.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	126,000	9.810	1,236,060.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	146,527	6.270	918,724.290	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	84,500	4.430	374,335.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	68,000	3.360	228,480.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	172,000	4.670	803,240.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	64,200	14.180	910,356.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	143,000	36.300	5,190,900.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	86,000	3.630	312,180.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,600	7.400	418,840.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	100,500	38.000	3,819,000.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	39,200	32.550	1,275,960.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	290,156	5.200	1,508,811.200	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	126,000	3.650	459,900.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,800	7.120	155,216.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	34,000	12.160	413,440.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	124,000	3.290	407,960.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,404,000	2.960	4,155,840.000	

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	29,000	47.600	1,380,400.000	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.850	1,054,900.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	115,500	19.460	2,247,630.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	110,000	7.720	849,200.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	130,800	8.180	1,069,944.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	438,000	2.780	1,217,640.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	39,000	27.650	1,078,350.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	164,000	6.710	1,100,440.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	88,500	3.380	299,130.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	211,000	5.440	1,147,840.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	66,000	9.120	601,920.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	26,000	14.000	364,000.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	540,000	4.630	2,500,200.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	27,000	96.300	2,600,100.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	52,000	15.760	819,520.000	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	12,500	34.950	436,875.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	79,000	40.900	3,231,100.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.990	459,080.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	21,900	126.000	2,759,400.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	19,000	12.380	235,220.000	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	20,000	26.500	530,000.000	
A-LIVING SERVICES CO LTD	22,500	41.150	925,875.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,512,000	1.560	3,918,720.000	
XIAOMI CORP	580,200	16.880	9,793,776.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	11,760	107.800	1,267,728.000	
MEITUAN DIANPING	193,800	208.200	40,349,160.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	44,400	13.860	615,384.000	

HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	40,000	34.300	1,372,000.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	208,000	8.200	1,705,600.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	54,000	59.150	3,194,100.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	472,000	1.660	783,520.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	75,000	14.480	1,086,000.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	94,500	33.800	3,194,100.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	81.150	470,670.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	28,000	15.900	445,200.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	3,000	225.400	676,200.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	62,000	10.000	620,000.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	26,000	36.350	945,100.000	
CHINA FEIHE LTD	46,000	15.560	715,760.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	85,561	27.600	2,361,483.600	
LUYE PHARMA GROUP LTD	109,500	4.980	545,310.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	24,000	34.400	825,600.000	
CGN POWER CO LTD	499,000	1.730	863,270.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	82,000	3.850	315,700.000	
GF SECURITIES CO LTD	68,200	10.420	710,644.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	21,600	20.650	446,040.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	79,000	15.480	1,222,920.000	
3SBIO INC	64,000	12.760	816,640.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	37,000	12.040	445,480.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	4.810	452,140.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	521,000	1.040	541,840.000	
CHINA LITERATURE LTD	15,600	61.050	952,380.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	64,000	4.910	314,240.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	44,000	3.690	162,360.000	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	6.720	430,080.000	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	8.990	584,350.000	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	154,000	0.990	152,460.000	
BOC AVIATION LTD	11,600	48.050	557,380.000	

	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	19,500	52.800	1,029,600.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	66,800	18.680	1,247,824.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	51,000	145.400	7,415,400.000	
香港・ドル	小計	48,986,935		641,364,657.850 (8,838,004,987)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	24,000	255.000	6,120,000.000	
	ACER INC	232,532	17.200	3,999,550.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	34,554	218.000	7,532,772.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	24,616	359.500	8,849,452.000	
	ASIA CEMENT CORP	111,928	46.300	5,182,266.400	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	20,000	178.500	3,570,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	309,779	10.950	3,392,080.050	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	48,000	82.000	3,936,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	34,000	118.000	4,012,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	44,975	85.600	3,849,860.000	
	QUANTA COMPUTER INC	165,858	77.000	12,771,066.000	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	26,070	43.150	1,124,920.500	
	EVA AIRWAYS CORP	145,125	11.200	1,625,400.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,760	226.000	9,211,760.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	274,771	19.450	5,344,295.950	
	CHINA AIRLINES	175,156	8.150	1,427,521.400	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	137,169	35.500	4,869,499.500	
	CHINA STEEL CORP	633,058	20.700	13,104,300.600	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	196,994	22.200	4,373,266.800	
	ADVANTECH CO LTD	17,889	321.500	5,751,313.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	198,304	20.000	3,966,080.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	109,663	183.500	20,123,160.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	62,000	59.600	3,695,200.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	199,327	111.000	22,125,297.000	
	AU OPTRONICS CORP	446,194	9.560	4,265,614.640	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	95,800	116.000	11,112,800.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	98,820	10.750	1,062,315.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	191,824	28.900	5,543,713.600	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	22,307	172.000	3,836,804.000	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	9,322	322.500	3,006,345.000	

NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	29,285	285.500	8,360,867.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	204,633	82.000	16,779,906.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	27,000	36.250	978,750.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	192,594	71.000	13,674,174.000	
GIANT MANUFACTURING	14,151	289.500	4,096,714.500	
MEDIATEK INC	82,507	616.000	50,824,312.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	365,936	42.400	15,515,686.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	383,459	20.150	7,726,698.850	
HOTAI MOTOR CO LTD	16,000	719.000	11,504,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	87,000	68.600	5,968,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	475,141	17.900	8,505,023.900	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	426,941	40.250	17,184,375.250	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	667,403	8.750	5,839,776.250	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	588,545	28.300	16,655,823.500	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	681,225	84.800	57,767,880.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	586,495	32.000	18,767,840.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	5,220	4,010.000	20,932,200.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	495,593	13.550	6,715,285.150	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	578,061	8.620	4,982,885.820	
INVENTEC CO LTD	124,005	27.250	3,379,136.250	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	114,845	46.700	5,363,261.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	532,443	10.950	5,830,250.850	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	969,048	20.900	20,253,103.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	570,852	23.000	13,129,596.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,560	112.000	4,206,720.000	
NAN YA PLASTICS CORP	283,828	63.300	17,966,312.400	
WISTRON CORP	141,916	32.550	4,619,365.800	
POU CHEN CORP	145,990	28.300	4,131,517.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	265,297	73.600	19,525,859.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	31,392	290.000	9,103,680.000	

	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	61,480	86.700	5,330,316.000	
	PHISON ELECTRONICS CORP	5,658	313.500	1,773,783.000	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	28,393	53.000	1,504,829.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	62,588	57.100	3,573,774.800	
	STANDARD FOODS CORP	13,639	66.000	900,174.000	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	91,899	42.700	3,924,087.300	
	TAIWAN CEMENT CORP	229,684	44.950	10,324,295.800	
	TATUNG CO LTD	60,000	20.800	1,248,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,336,083	348.500	465,624,925.500	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	552,525	16.450	9,089,036.250	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	268,000	13.100	3,510,800.000	
	YAGEO CORP	21,160	370.500	7,839,780.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	98,000	35.400	3,469,200.000	
	INNOLUX CORPORATION	425,345	8.050	3,424,027.250	
	WPG HOLDINGS CO LTD	77,203	41.450	3,200,064.350	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	11,645	299.000	3,481,855.000	
	PEGATRON CORP	96,554	63.700	6,150,489.800	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	7,000	523.000	3,661,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	17,000	311.500	5,295,500.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	63,470	125.000	7,933,750.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	30,385	132.500	4,026,012.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	442,674	21.100	9,340,421.400	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	160,993	47.500	7,647,167.500	
	WIWYNN CORP	3,000	781.000	2,343,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	193,903	71.600	13,883,454.800	
	SILERGY CORP	4,000	1,870.000	7,480,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	10,000	423.000	4,230,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	329.500	1,977,000.000	
	台湾・ドル 小計	17,633,441		1,191,260,600.410 (4,312,363,373)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	14,789	142.000	2,100,038.000	
	CLICKS GROUP LTD	13,514	202.690	2,739,152.660	
	DISCOVERY LTD	18,524	104.410	1,934,090.840	
	GOLD FIELDS LTD	50,685	177.320	8,987,464.200	
	REMGRO LTD	29,243	93.910	2,746,210.130	

NORTHAM PLATINUM LTD	18,300	129.320	2,366,556.000	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	39,505	17.570	694,102.850	
EXXARO RESOURCES LTD	16,476	129.440	2,132,653.440	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,333	825.680	1,926,311.440	
MTN GROUP LTD	82,853	56.290	4,663,795.370	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	23,889	525.640	12,557,013.960	
FIRSTRAND LTD	275,168	41.470	11,411,216.960	
PSG GROUP LTD	8,154	160.000	1,304,640.000	
NASPERS LTD	24,174	3,239.900	78,321,342.600	
NEDBANK GROUP LTD	17,539	119.300	2,092,402.700	
PICK'N PAY STORES LTD	14,915	48.640	725,465.600	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,816	1,330.000	3,745,280.000	
SASOL LTD	26,603	133.440	3,549,904.320	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	26,124	106.000	2,769,144.000	
MR PRICE GROUP LTD	17,420	136.270	2,373,823.400	
STANDARD BANK GROUP LTD	66,539	112.390	7,478,318.210	
SPAR GROUP LTD/THE	13,411	174.500	2,340,219.500	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	73,616	33.250	2,447,732.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	19,708	141.880	2,796,171.040	
ABSA GROUP LTD	38,935	86.000	3,348,410.000	
TIGER BRANDS LTD	9,616	182.170	1,751,746.720	
SANLAM LTD	97,752	61.520	6,013,703.040	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	39,032	138.430	5,403,199.760	
KUMBA IRON ORE LTD	3,074	463.040	1,423,384.960	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	113,613	17.290	1,964,368.770	
RMI HOLDINGS	67,629	30.000	2,028,870.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	31,817	122.310	3,891,537.270	
NEPI ROCKCASTLE PLC	23,695	92.130	2,183,020.350	
OLD MUTUAL LTD	314,636	12.630	3,973,852.680	
REINET INVESTMENTS SCA	7,021	294.370	2,066,771.770	
PEPKOR HOLDINGS LTD	16,633	10.350	172,151.550	
MULTICHOICE GROUP LTD	21,712	106.020	2,301,906.240	
SIBANYE STILLWATER LTD	108,872	40.050	4,360,323.600	
BID CORP LTD	17,793	278.110	4,948,411.230	
南アフリカ・ランド 小計	1,808,128		210,034,707.160 (1,335,820,738)	
合計	134,401,466		35,799,091,148 (35,799,091,148)	

(2) 株式以外の有価証券

令和2年7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	9,181.050	
	タイ・パーツ 小計		9,465.000	9,181.050 (31,307)	
新株予約権証券 合計			9,465	31,307 (31,307)	
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	10,900.000	930,860.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	20,000.000	580,600.000	
		ENERGISA SA	15,000.000	713,550.000	
		KLABIN SA	33,600.000	687,120.000	
		SUL AMERICA SA	14,069.000	675,312.000	
	ブラジル・レアル 小計		93,569.000	3,587,442.000 (71,964,087)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	783,375.000	4,668,915.000	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	26,200.000	2,552,928.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	108,400.000	14,363,000.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	129,600.000	3,132,432.000	
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV		9,000.000	637,920.000		
メキシコ・ペソ 小計		1,056,575.000	25,355,195.000 (120,437,177)		
投資信託受益証券 合計			1,150,144	192,401,264 (192,401,264)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	163,600.000	2,956,252.000	
	メキシコ・ペソ 小計		163,600.000	2,956,252.000 (14,042,197)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	220,736.000	3,112,377.600	
	南アフリカ・ランド 小計		220,736.000	3,112,377.600 (19,794,722)	
投資証券 合計			384,336	33,836,919 (33,836,919)	
合計				226,269,490 (226,269,490)	

(注) 新株予約権証券、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 (%)	組入新株 予約権証券 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 58銘柄	14.60	-	-	-	16.89
アラブ首長国連邦・ディル ハム	株式 8銘柄	0.44	-	-	-	0.51
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.06	-	-	-	0.08
インド・ルピー	株式 87銘柄	6.82	-	-	-	7.89
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.24	-	-	-	1.43
オフショア・人民元	株式 360銘柄	4.34	-	-	-	5.02
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.61	-	-	-	0.71
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.16	-	-	-	0.19
サウジアラビア・リアル	株式 34銘柄	2.19	-	-	-	2.53
タイ・バーツ	株式 43銘柄	1.81	-	-	-	2.09
	新株予約権証 券 1銘柄	-	0.00	-	-	
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.10	-	-	-	0.12
チリ・ペソ	株式 16銘柄	0.49	-	-	-	0.57
トルコ・リラ	株式 15銘柄	0.35	-	-	-	0.40
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.18	-	-	-	0.21
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.01	-	-	-	0.01
フィリピン・ペソ	株式 21銘柄	0.68	-	-	-	0.78
ブラジル・レアル	株式 51銘柄	4.31	-	-	-	5.19
	投資信託受益 証券 5銘柄	-	-	0.17	-	
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.57	-	-	-	0.66
マレーシア・リングgit	株式 39銘柄	1.50	-	-	-	1.73
メキシコ・ペソ	株式 18銘柄	1.06	-	-	-	1.60
	投資信託受益 証券 5銘柄	-	-	0.29	-	
	投資証券 1銘柄	-	-	-	0.03	
ユーロ	株式 5銘柄	0.11	-	-	-	0.13
韓国・ウォン	株式 107銘柄	9.51	-	-	-	11.00
香港・ドル	株式 207銘柄	21.21	-	-	-	24.53
台湾・ドル	株式 88銘柄	10.35	-	-	-	11.97
南アフリカ・ランド	株式 39銘柄	3.21	-	-	-	3.76
	投資証券 1銘柄	-	-	-	0.05	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和2年7月31日現在

資産総額	246,332,760,902円
負債総額	2,163,194,421円
純資産総額（ - ）	244,169,566,481円
発行済数量	199,501,338,171口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2239円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	215,787,206,081円
負債総額	694,670,500円
純資産総額（ - ）	215,092,535,581円
発行済数量	164,142,704,059口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3104円

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	210,808,939,362円
負債総額	760,776,805円
純資産総額（ - ）	210,048,162,557円
発行済数量	87,447,163,142口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4020円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	395,016,761,491円
負債総額	9,812,522,100円
純資産総額（ - ）	385,204,239,391円
発行済数量	259,039,083,448口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4871円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	361,127,340,202円
負債総額	418,656,237円
純資産総額（ - ）	360,708,683,965円
発行済数量	94,484,282,214口
1口当たり純資産額（ / ）	3.8177円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	44,883,115,251円
負債総額	647,360,092円
純資産総額(-)	44,235,755,159円
発行済数量	23,461,469,977口
1口当たり純資産額(/)	1.8855円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	37,981,836,899円
負債総額	251,846,466円
純資産総額(-)	37,729,990,433円
発行済数量	34,274,991,207口
1口当たり純資産額(/)	1.1008円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	115,907,644,368円
負債総額	603,200,000円
純資産総額(-)	115,304,444,368円
発行済数量	55,860,054,728口
1口当たり純資産額(/)	2.0642円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	41,310,895,959円
負債総額	143,571,076円
純資産総額(-)	41,167,324,883円
発行済数量	36,032,366,695口
1口当たり純資産額(/)	1.1425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(2020年7月31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(2020年7月31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。

2020年7月31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	26	1,216,222,423,902
追加型株式投資信託	861	13,687,667,821,911
単位型公社債投資信託	36	92,342,483,722
単位型株式投資信託	188	1,257,025,532,490
合計	1,111	16,253,258,262,025

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。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第35期事業年度（自2019年4月1日至2020年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
1 建物	1,096,916	1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
1,522,040	221,784	
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
4,499,196	5,299,196	
長期差入保証金	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(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	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

(3)【株主資本等変動計算書】

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
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期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	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
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
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期変動額(純額)			-	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
					別途 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	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

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、2016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）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>
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。

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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自2018年4月1日至2019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
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21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

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
2019年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種 類株式					

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21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
2020年6月17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
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（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あります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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おります。

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あります。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34期(2019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	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

第35期(2020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	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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 その他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第34期(2019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	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

第35期(2020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	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

(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34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)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、記載していません。

2. その他有価証券

第34期(2019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	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
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	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

(注)非上場株式(貸借対照表計上額276,764千円)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35期(2020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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
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	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)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34期(自 2018年4月1日 至 2019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	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

(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、償還によるものであります。

(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。

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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(4) 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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

(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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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、2016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、2016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

2016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) 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

(2) 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	

(3) 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。

(4) 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

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
子 会 社	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	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
								子会社株式 の取得	10,294,840	未払 手数料	1,231,431
子 会 社	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

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) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
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	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510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。

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (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

2020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おります。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250	日本において銀行業務を営んでおります。
ソニー銀行株式会社	31,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社イオン銀行	51,250	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社青森銀行	19,562	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北都銀行	12,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社荘内銀行	8,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社岩手銀行	12,089	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東北銀行	13,200	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社七十七銀行	24,658	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社群馬銀行	48,652	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社足利銀行	135,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社常陽銀行	85,113	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社筑波銀行	48,868	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社武蔵野銀行	45,743	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉銀行	145,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉興業銀行	62,120	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第四銀行	32,776	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北越銀行	24,538	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山銀行	6,730	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社静岡銀行	90,800	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社清水銀行	10,816	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。

株式会社十六銀行	36,839	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京都銀行	42,103	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社関西みらい銀行	38,971	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社南都銀行	37,924	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社鳥取銀行	9,061	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社伊予銀行	20,900	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社佐賀銀行	16,062	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大分銀行	19,598	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社宮崎銀行	14,697	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西日本シティ銀行	85,745	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北洋銀行	121,101	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北日本銀行	7,761	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社仙台銀行	22,485	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福島銀行	18,682	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大東銀行	14,743	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東和銀行	38,653	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社栃木銀行	27,408	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京葉銀行	49,759	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東日本銀行	38,300	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東京スター銀行	26,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	5,191	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山第一銀行	10,182	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社愛知銀行	18,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第三銀行	37,461	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社トマト銀行	17,810	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社徳島大正銀行	11,036	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社香川銀行	12,014	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社長崎銀行	6,121	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	(1) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一勧業信用組合	(1) 14,132	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
八十二証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

auカブコム証券株式会社	7,196	「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。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社	1,500	「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。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	「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。
九州FG証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
きらぼしライフデザイン証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ごうぎん証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
静岡東海証券株式会社	600	「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。
七十七証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
北洋証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「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。
頭川証券株式会社	175	「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。
楽天証券株式会社	7,495	「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。
東海東京証券株式会社	6,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
とうほう証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
南都まほろば証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「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。
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。

株式会社証券ジャパン	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
野村證券株式会社(2)	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
浜銀TT証券株式会社	3,307	「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。
フィデリティ証券株式会社	10,007	「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。
松井証券株式会社	11,945	「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。
水戸証券株式会社	12,272	「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。
山形証券株式会社	100	「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2020年3月末日現在

(1) 出資の総額

(2) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

(3) 投資顧問会社

a. 名称

アセットマネジメントOne U.S.A.・インク

b. 資本金の額

2019年12月末日現在 400万米ドル

c. 事業の内容

米国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) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

3【資本関係】

委託会社は、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの株式を、100%保有しています。

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

2020年5月27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
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

監査意見

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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。

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2020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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

令和2年8月14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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印
業務執行社員

監査意見

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」に掲げられている投資のソムリエの令和2年1月15日から令和2年7月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、投資のソムリエの令和2年7月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。